

6541	945546541	894564
1531	546541531	+6859
1153	215341153	865416
45-	145545-	5789+
4+9	++32154+9	6+564
31	4878*631	654+6
44	@//=-98744	5 9 /-
65	9+7444565	8* /96+
4	445445454	615489
	654546545	486513
	8-5@65+6	216574
	52+656454	984214
	245687958	654897
	4@465454	611654
	121245648	864165
	945546541	894564
	546541531	+6859
	215341153	865416
	145545-	5789+
	++32154+9	6+564
	4878*631	654+6
	@//=-98744	5 9 /-
	-7444565	8* /96+
	5445454	615489
	546545	486513
	@65+6	216574
	56454	984214
	87958	654897
	5454	611654
	648	864165
	541	894564
	31	+6859
	63	865416
		5789+
		6+564
		654+6
		5 9 /-
		8* /96+
		615489
		486513
		216574
		984214
		654897
		611654
		864165
		894564
		+6859
		865416
		89+
		564
		+6
		/-
		+
		9
		3



مركز البحوث

# التنبؤ بالمبيعات بين النظرية والتطبيق

تأليف  
ريجي بوربوني جان كلود إيزينيه

ترجمة  
د . أيمن نايف العشعوش

راجع الترجمة  
د . صالح بن ضحوي العنزي

بسم الله الرحمن الرحيم



مركز البحوث

# التنبؤ بالمبيعات بين النظرية والتطبيق

تأليف

ريجي بوربوني    جان كلود إيزينيه

ترجمة

د. أيمن نايف العشعوش

راجع الترجمة

د. صالح بن ضحوي العنزي

١٤٢٩هـ - ٢٠٠٨م

## بطاقة الفهرسة

ح) معهد الإدارة العامة، ١٤٢٩هـ.

فهرسة مكتبة الملك فهد الوطنية أثناء النشر.

بوربوني، ريجي

التنبؤ بالمبيعات بين النظرية والتطبيق.

ريجى بوربوني، جان كلود إيزينيه.

أيمن نايف العشعوش - الرياض ١٤٢٩هـ

٣٤٨ ص: ١٧ × ٢٤ سم.

ردمك: ١-١٦٧-١٤-٩٩٦٠-٩٧٨

١- التسويق ٢- إدارة المبيعات ٣- التوقعات

أ - إيزينيه، جان كلود (مؤلف مشارك)

ب - العشعوش، أيمن نايف (مترجم) ج - العنوان

١٤٢٩/٨١٧٦

ديوي ٦٥٨,٨١

رقم الإيداع: ١٤٢٩/٨١٧٦

ردمك: ١-١٦٧-١٤-٩٩٦٠-٩٧٨

هذه ترجمة لكتاب:

# **Prévision des Ventes**

**Théorie et pratique**

**3<sup>e</sup> édition**

**Régis BOURBONNAIS  
Jean-Claude USUNIER**

Ed. ECONOMICA, 2001





## قائمة المحتويات

رقم الصفحة	الموضوع
١٥	- مقدمة .....
١٩	- الجزء الأول: التنبؤ: الحاجات والأساليب .....
٢١	- الفصل الأول: التنبؤ بالمبيعات - بعض الأفكار الأولية .....
٢١	١- لماذا نجرى تنبؤاً للمبيعات؟ .....
٢١	١-١- التنبؤ يحدد الحدود المثلى للتموين .....
٢٢	١-٢- إلزامية (ضرورة) التنبؤ مرتبطة بفترة الاستجابة للمنشأة .....
٢٢	٢- خصائص مشكلة التنبؤ .....
٢٤	٣- مواصفات الحل التنبؤي .....
٢٥	٣-١- البيانات الواجب التنبؤ بها .....
	٣-٢- الفترة الفاصلة بين بيانات التنبؤ (تردد البيانات) والمجال الزمني للتنبؤ .....
٢٦	٣-٣- كيفية اختيار الطريقة المناسبة .....
٢٧	٣-٤- الحل الآلي ونظام المعلومات .....
٢٨	٣-٥- التنبؤ ومدى صلاحيته .....
٢٨	٤- تعريف التنبؤ .....
٣١	٤-١- التنبؤ والهدف المنشود للمنشأة .....
٣٢	٤-٢- بعض التعاريف الأولية .....
٣٢	٥- من الذي يقوم بالتنبؤ؟ .....
٣٥	٥-١- عملية إعداد التنبؤ .....
	٥-٢- التنبؤ باعتباره أداة مساعدة في اتخاذ القرار .....
٣٧	- الفصل الثاني: تفكيك السلسلة الزمنية للمبيعات إلى مكوناتها الأساسية .....
٣٧	١- مفهوم المسار التتابعى للسلسلة Historique .....
٣٩	٢- حساب المؤشرات الإحصائية الأساسية وتمثيل البيانات .....
٣٩	٢-١- حساب المقاييس الأساسية .....
٤١	٢-٢- تمثيل البيانات .....

الموضوع	رقم الصفحة
٣- تحليل السلسلة الزمنية وإجراء التنبؤ	٤٦
١-٢-١ مراحل التنبؤ بالمبيعات	٤٦
٢-٢-٢ البحث عن القيم الشاذة وتصحيحها	٤٧
١-٢-٢-١ الكشف عن القيم الشاذة	٤٨
٢-٢-٢-٢ تصحيح القيم الشاذة	٥١
٢-٢-٣ مخطط تفكيك السلسلة الزمنية	٥٢
٤-٢-٣ مركبة الاتجاه العام La tendance	٥٤
٥-٢-٣ المركبة الفصلية La saisonnalité	٥٧
١-٥-٢-٣ لماذا نحلل الحركة الفصلية؟	٥٧
٢-٥-٢-٢ تصحيح أيام العمل	٥٨
٣-٥-٢-٢ حساب المركبة الفصلية	٥٩
٤-٥-٢-٢ الاختبار الإحصائي للمركبة الفصلية	٧١
٥-٥-٢-٢ المركبة الفصلية لمجموعة من السلع Famille de saisonnalité	٧٥
٦-٢-٢ المركبة الدورية (الحلقية) La composante cyclique	٧٥
٧-٢-٢ عامل البواقي Le facteur résiduel	٧٦
١- الفصل الثالث: الطرائق الأساسية للتنبؤ (١): الطرائق المستندة إلى الصقل الأسى	٧٧
١- خصائص طرائق الصقل الأسى	٧٧
١-١-١ مبادئ أساسية	٧٧
٢-١-٢ العرض الرياضي	٧٨
٣-١-٢ دور ثابت الصقل	٨١
٢- الصقل الأسى البسيط: النموذج المستقر Le modèle stationnaire	٨٢
٣- الصقل الأسى المضاعف: النموذج الخطي Le modèle linéaire	٨٤
٤- نماذج Holt و Holt-Winters	٨٨
٤-١-٤ نموذج Holt	٨٨

٨٩	٢-٤- النموذج المتضمن مركبة الاتجاه العام والمركبة الفصلية (نموذج Holt-Winters)
٩٣	٥- كيفية اختيار معامل الصقل
٩٣	١-٥- مبادئ عامة
٩٤	٢-٥- قيمة $a$ التي تجعل مجموع مربعات أخطاء التنبؤ في حده الأدنى
٩٥	٢-٥- طريقة ضبط معامل الصقل
٩٥	١-٢-٥- مبادئ عامة
٩٦	٢-٢-٥- متغيرات المراقبة Les variables de contrôle
١٠٠	٢-٢-٥- تطبيق
	- الفصل الرابع: الطرائق الأساسية للتنبؤ (٢): طرائق بوكس-جانكينز
١٠٥	BOX- JENKINS والنماذج السببية
١٠٥	١- الارتباط البسيط والتمثيل البياني لتابع الارتباط الذاتي
١٠٥	١-١- الارتباط البسيط
١٠٦	١-١-١- قياس معامل الارتباط الخطي
١٠٨	١-١-٢- محدودية مفهوم الارتباط
١٠٩	١-٢- تابع الارتباط الذاتي وتمثيله البياني
١١٤	١-٢-١- مقدمة في طريقة بوكس وجانكينز
١١٥	١-٢-١- دراسة النماذج
١١٨	١-٢-٢- السياقات المستقرة
١١٨	١-٢-٣- البحث عن التمثيل المناسب للمعطيات
١٢٢	٢- الطريقة الخارجية لإجراء التنبؤ
١٢٢	١-٢- مفهوم توفيق البيانات ونموذج الانحدار البسيط
١٢٤	٢-٢- النماذج ذات المتغيرات التفسيرية: الاقتصاد القياسى
١٢٦	٢-٢- التفسير الإحصائى للنموذج
	٢-٤- أمثلة للتقدير الاقتصادى القياسى بواسطة تقنيات البرنامج
١٣١	إكسل
١٣٦	٢-٥- اختيار المتغيرات التفسيرية



الموضوع	رقم الصفحة
- الجزء الثانى: استخدام التنبؤ فى القطاعات المختلفة	١٤٣
- الفصل الخامس: التنبؤ فى الوسط الصناعى	١٤٥
١- السلع الصناعية ومبدأ القطاع الأعلى (الأساس)	١٤٥
١-١- الأنماط المختلفة للإحصائيات الصناعية	١٤٥
٢-١- أنماط السلع الصناعية وقابلية التنبؤ	١٤٦
٣-١- مبدأ القطاع الأعلى (الأساس)	١٤٧
٢- النموذج ذو المؤشرات التقديمية Le modèle à indicateurs en avance	١٥٠
٣- العوامل (المتغيرات) التفسيرية	١٥٤
٤- التنبؤ فى مجال الصناعات الحديدية	١٥٦
٤-١- عرض المشكلة	١٥٦
٤-٢- الانتقاء الآلى للمتغيرات التفسيرية وللتأخيرات الزمنية	١٥٧
٤-٣- استخدام النموذج وإجراء التنبؤ	١٦٠
٥- التنبؤ فى مجال الأجهزة الكهربائية	١٦١
٥-١- عرض المشكلة	١٦١
٥-٢- طريقة التنبؤ لفرنسا	١٦٢
٥-٢-١- إدخال الحالة الاقتصادية العامة	١٦٢
٥-٢-٢- التنبؤ على مستوى المجموعة المتجانسة من المنتجات	١٦٤
٥-٢-٢- التنبؤ على مستوى رقم المنتج Référence	١٦٨
٥-٣- التنبؤ بواسطة الفروع ودمجها	١٦٩
- الفصل السادس: قطاع السلع الاستهلاكية المعمرة	١٧١
١- خصائص قطاع السلع الاستهلاكية المعمرة	١٧١
١-١- البيع يتم للأسر	١٧١
٢-١- للسلع سوق مضاعف	١٧١
٣-١- للمنشآت إمكانية التأثير فى السوق	١٧٢
٤-١- فلتر مراقبة التوزيع	١٧٣
٥-١- تأثر المبيعات من السلع المعمرة ببعض الأحداث	١٧٣

الموضوع	رقم الصفحة
٢- معدل التجهيز وطلب الاستبدال: مثال السيارات	١٧٤
٢-١- المبدأ الأساسي	١٧٤
٢-٢- نموذج التنبؤ متوسط الأجل	١٧٥
٢-٣- إدخال المتغيرات التفسيرية في النموذج	١٧٨
٢-٤- التنبؤ القصير الأجل	١٧٩
٣- التأثير للحوادث الاستثنائية: مثال أجهزة الفيديو	١٨٠
٢-١- وضع المسألة وطريقة المعالجة	١٨٠
٢-٢- إدخال الحوادث الاستثنائية باستخدام متغير صامت	١٨٠
٤- التنبؤ للأسواق الجديدة: سوق الهاتف المحمول	١٨١
٤-١- عرض المشكلة	١٨١
٤-٢- التنبؤ بالسوق	١٨٢
٤-٣- التنبؤ بحصص السوق	١٨٥
٤-٤- التنبؤ بعدد المشتركين	١٨٥
٥- مثال للتنبؤ ببيع قطع غيار السيارات: إنشاء شبكة إمداد متكاملة	
chaîne logistique intégrée	١٨٦
٥-١- عرض المسألة	١٨٦
٥-٢- الخطة التسويقية للمبيعات	١٨٧
٥-٣- تحضير الميزانية المتحركة للمبيعات	١٨٨
٥-٤- التنبؤ بالمبيعات حسب رقم المنتج (Référence)	١٨٩
٥-٥- خطة التموين والإمداد	١٩٠
الفصل السابع: المنتجات ذات الاستهلاك الكبير (١): دورة حياة المنتج والمرونة	١٩٣
١- دورة حياة المنتج	١٩٤
١-١- عرض المسألة	١٩٤
١-٢- نماذج منحني حياة المنتج	١٩٧
١-٣- طرائق التقدير	١٩٩
١-٤- مثال لتحديد النموذج وتقدير المعاملات	٢٠٠

الموضوع	رقم الصفحة
٢- إدخال مكونات المزيج التسويقي Marketing Mix	٢٠٣
٢-١- كيف يقاس تأثير ارتفاع الأسعار؟	٢٠٦
٢-٢- المركبة الفصلية وترويج المبيعات Promotion	٢٠٨
٢-٢-٣- التنبؤ للمنتجات ذات الضغط التسويقي الضعيف	٢٠٩
٢- التنبؤ الأسبوعي: حالة المنتجات الطازجة	٢١٠
٢-١- طريقة التنبؤ الأسبوعي	٢١٠
٢-٢- مثال تطبيقي في مجال منتجات الجبن	٢١٢
٤- حساب المرونات والتنبؤ بتأثير الإجراءات التسويقية	٢١٦
٤-١- عرض طريقة التقدير	٢١٦
٤-٢- أمثلة حسابية	٢١٨
٤-٣- قياس المرونة السعرية وتقييم تأثير الدعاية	٢٢٢
٤-٤- نماذج عن فعالية الإجراءات الترويجية	٢٢٢
- الفصل الثامن: المنتجات ذات الاستهلاك الكبير (٢): التنبؤ باستخدام	
المعطيات الضوئية Scanner	٢٢٥
١- إيجاد النموذج لخيارات المستهلكين	٢٢٦
١-١- مجموعات الاختبار Panels والمعطيات الضوئية	٢٢٦
٢-١- مجموعة نماذج Logit	٢٢٩
٢- التنبؤ بالمبيعات للمنتجات الجديدة وقياس الفعالية الإعلانية بواسطة	
المعطيات ذات المصدر الواحد	٢٣١
١-٢- مفهوم معطيات «المصدر الواحد» single source	٢٣٢
٢-٢- الاختبارات للمنتجات الجديدة وللخطط التسويقية: مثال	
منتج بقالة جديد	٢٣٣
٢-٢- قياس الفعالية الإعلانية	٢٣٥
٢- التنبؤ السنوي بالمبيعات باستخدام قواعد المعطيات الضوئية	٢٣٦
١-٢- قواعد المعطيات والمخطط العام للتنبؤ	٢٣٦
٢-٢- الإسقاط للسوق الاختباري	٢٣٧
٢-٢- التصحيحات الزمنية والمكانية وإعادة التجميع للحصول على	
التنبؤ لمدة عام	٢٣٨

الموضوع	رقم	الصفحة
٤- التنبؤ بصدق (إخلاص) الزبائن	٢٣٩	
٤-١- تحليل إخلاص (وفاء) الزبائن	٢٤١	
٤-٢- القيمة الاقتصادية للزبائن	٢٤١	
٤-٣- القيمة الاقتصادية وإدارة إخلاص الزبائن	٢٤٢	
- الفصل التاسع: التنبؤ للمجالات الزمنية القصيرة جداً ضمن شروط		
خاصة	٢٤٥	
١- التنبؤ بالأنشطة اليومية	٢٤٥	
١-١- عرض المشكلة	٢٤٥	
١-٢- المنهجية العامة	٢٤٦	
٢- مثال تطبيقي: كم عدد زوار برج إيفل؟	٢٤٧	
١-٢- إطار الدراسة	٢٤٧	
٢-٢- التحليل الداخلى للسلسلة الزمنية	٢٤٧	
٢-٢-١- تصحيح أشهر التشرين الثانى وكانون الأول من العام ١٩٩٥	٢٤٨	
٢-٢-٢- حساب المركبة الفصلية الأسبوعية	٢٤٩	
٢-٢-٢- حساب المركبة الفصلية اليومية	٢٥٠	
٢-٢-٤- حساب السلاسل الزمنية المصححة من التقلبات		
الفصلية CVS الأسبوعية واليومية	٢٥٠	
٢-٢-٣- تحليل الظواهر الخارجية	٢٥١	
١-٢-٣- تحليل الارتباط	٢٥١	
٢-٢-٣- إيجاد النموذج الرياضى	٢٥٣	
٢-٢-٣- نزع التأثيرات الخارجية	٢٥٥	
٢-٢-٤- التنبؤ بواسطة نموذج Holt للصقل	٢٥٦	
٢-٥- محاكاة النموذج وتحليل الانحرافات	٢٥٧	
٢-٦- التنبؤ لشهر حزيران عام ١٩٩٦	٢٥٧	
٢- التنبؤ للمنتجات ذات فترة الحياة القصيرة والمحددة	٢٦٠	
١-٢- عرض المسألة	٢٦٠	
٢-٢- طريقة المعالجة	٢٦١	



الموضوع	رقم الصفحة
٢-٢- طريقة الكشف عن التوفيق الأمثل لخصائص المنتج .....	٢٦٢
٢-٤- الطريقة التفسيرية بواسطة تجميع الطلبيات .....	٢٦٢
٤- المخطط العام للتنبؤ فى قطاع الألبسة النسيجية .....	٢٦٨
٤-١- خصائص القطاع .....	٢٦٨
٤-٢- طريقة التنبؤ .....	٢٦٩
الجزء الثالث: إنشاء وتثبيت نظام التنبؤ .....	٢٧١
الفصل العاشر: تثبيت نظام التنبؤ .....	٢٧٣
١- كيفية تحليل مسألة تثبيت نظام التنبؤ .....	٢٧٣
١-١- تعريف النظام .....	٢٧٣
١-٢- الشراء أو التصميم .....	٢٧٤
١-٣- تشكيل الفريق .....	٢٧٥
٢- الخيارات المتاحة عند تثبيت النظام .....	٢٧٦
٢-١- بنية المعطيات: التدرج .....	٢٧٧
٢-٢- بم يجب أن نتنبأ؟ .....	٢٧٨
٢-٢- مستوى حساب التنبؤ والتحقق من صلاحيته .....	٢٨٠
٢-٤- دورية تحديث التنبؤ .....	٢٨٢
٢-٥- التجانس بين التنبؤات الشهرية والتنبؤات الأسبوعية .....	٢٨٣
٢-٦- استخدام سجل الطلبيات Order Book .....	٢٨٥
٢-٧- الحلول الآلية .....	٢٨٧
٣- طريقة إدخال التنبؤ فى نظام الإدارة .....	٢٩٠
٢-١- التنبؤات الأولية .....	٢٩١
٢-٢- التنبؤ باعتباره أداة من أدوات المنشأة .....	٢٩٢
٢-٣- الفترة اللازمة لتثبيت النظام .....	٢٩٣
٢-٤- التكلفة .....	٢٩٣
٤- البحث عن العوامل التفسيرية ومصادر المعلومات .....	٢٩٥
٤-١- تصنيف المعطيات .....	٢٩٥
٤-٢- مصادر المعطيات .....	٢٩٧

٢٩٩	- الفصل الحادى عشر: تقييم واختيار طرائق التنبؤ
٢٩٩	١- قياس الجودة لتنبؤ ما
٢٩٩	١-١- مؤشرات القياس
٣٠١	٢-١- التحيز فى التنبؤ
٣٠٢	٣-١- تقارب التنبؤ
٣٠٤	٤-١- الكشف عن أسباب الخطأ
٣٠٥	٥-١- ما هو خطأ التنبؤ المسموح به؟
٣٠٦	٦-١- المحاكاة La simulation
٣٠٧	٢- تقييم جودة التنبؤ لعدة سلع معاً
٣٠٨	١-٢- حساب مؤشر ترجيحى
٣٠٩	٢-٢- التقييم بواسطة الرسوم البيانية
٣١١	٣- إجراءات التقييم
٣١١	١-٣- فترة الاختبار
٣١٢	٢-٣- المقارنة بين التنبؤات
٣١٤	٣-٣- بعض المؤشرات المهمة
٣١٥	٤- مقارنة وتوفيق عدة طرائق للتنبؤ
٣١٥	١-٤- مقارنة طرائق التنبؤ
٣١٧	٢-٤- توفيق طرائق التنبؤ
٣١٨	٥- اختيار تقنية التنبؤ
٣١٨	١-٥- معايير الانتقاء
٣١٩	٢-٥- الخيارات الأساسية الثلاثة
٣٢٠	٣-٥- تبدل التقنية المستخدمة تبعاً لمراحل دورة حياة المنتج
٣٢٣	- خاتمة
٣٢٥	- المراجع
٣٢٣	- الجداول الإحصائية



## مقدمة:

يتم التنبؤ باستخدام مجموعة من الطرائق المختلفة فيما بينها بهدف تخفيض درجة الشك المرتبطة بعدم معرفة المستقبل، ويكون التحدى كبيراً من أجل المنشآت التجارية التي لن تستطيع، حتى فى حال امتلاكها للقدرة على التأقلم والتحرك السريعين، أن تخلص نفسها من التطورات التي ستحصل ضمن بيئة عملها. بالإضافة إلى ذلك، فإن القرار سيكون مكلفاً جداً فيما لو كانت التنبؤات التي استندت إليها المنشأة غير صحيحة. من هنا نفهم سبب تخصيص بعض المنشآت إمكانيات كبيرة لإجراء تنبؤات صحيحة.

تختلف طرائق التنبؤ وفقاً للحاجات المرتبطة به، وهناك ثلاثة معايير يمكن الاستناد إليها فى تقسيم أنماط التنبؤ هي:

- الفترة الزمنية: قصيرة، متوسطة أو طويلة الأمد.
- الدقة: اقتصاد جزئى ( مؤسسية، سوق، قطاع)، أو اقتصاد كلى (قطاع، فروع، الجامعات الأساسية للحسابات القومية).
- التقنية المستخدمة: نوعية (استخدام التحكيم العقلانى) أو كمية (استخدام التقديرات الإحصائية).

تمتاز المعايير السابقة بالاستقلالية فيما بينها، فمن الممكن إنشاء تنبؤ قصير الأجل بواسطة تقنية نوعية أو تنبؤ طويل الأجل لمعطيات اقتصادية كلية بواسطة تقنية كمية.

هذه العناصر المختلفة للمعايير السابقة تجعل طرائق التنبؤ الواجب استخدامها مختلفة تبعاً للحاجة إلى المعلومات المرغوب إجراء التنبؤ حولها، ومن هنا فمن الصعب أن نعالج فى كتاب واحد مجموعة من المواضيع بهذا الاتساع ومن ثم سنخصص هذا الكتاب للمواضيع الأساسية المتعلقة بالتنبؤ الكمي القصير الأجل للمنشأة فى حين ستكون الأوجه الأخرى للتنبؤ معروضة بشكل مختصر<sup>(١)</sup>.

بالإضافة إلى العرض النظرى لطرائق التنبؤ، يهتم المؤلفان بالجانب التطبيقي لهذه الطرائق، ومن أجل ذلك ومن خلال حالات عملية، يشرح المؤلفان طريقة المعالجة الإحصائية وكيفية تطبيقها على المعطيات المتاحة باستخدام المعالجة الآلية لنظام التنبؤ.

بالإضافة إلى ما سبق، فإن هذا الكتاب يتضمن أيضاً كيفية فهم آلية تحديد طريقة التنبؤ المناسبة ونمط نموذج التنبؤ وذلك تبعاً للقطاع المستخدم أو للمجال الزمنى المرغوب أو للاستخدام العملى.

---

(١) يستخدم هذا الكتاب طريقة تعتمد على تحليل السلاسل الزمنية ولن يتعرض (إلا باختصار) للتسويق الكمي عندما يكون مستنداً إلى معطيات مأخوذة من استطلاعات لآراء المستهلكين.



## لماذا نستخدم النماذج؟

الكثير من الأشخاص يستخدمون التنبؤ بأشكاله المختلفة، ولكن القليل منهم من يعترف بوجود آلية منطقية أو نموذج رياضي في التنبؤ أو في أي تحليل لنظام اجتماعي أو فيزيائي. لنأخذ على سبيل المثال، وكيل صرف العملات في أحد البنوك الذي يقول بأن مؤشر السوق المالي سيرتفع العام القادم. وهو يتنبأ بذلك لأنه رأى هذا المؤشر مرتفعاً خلال السنوات الأخيرة ولاعتقاده بأنه سيستمر في الارتفاع مهما كانت الأسباب التي أدت إلى ارتفاعه في السنوات السابقة.

ولكن من الممكن أيضاً الاعتقاد بأن المؤشر المالي سيرتفع: لأن هناك علاقة معقدة تربطه بمجموعة من المتغيرات الاقتصادية الكلية والمتغيرات السياسية. فمن الممكن لعامل الصرف أن يتصور علاقة ما بين المؤشر المالي والنتائج القومي الخام أو النتائج المالية للمنشأة أو معدل الفائدة في حال استند إلى بعض الفرضيات المعقولة المتعلقة بالتحرك المستقبلي لهذه المتغيرات وبارتباطها بالارتفاع المتوقع للمؤشر المالي.

إن كان هناك من كلمة تصف طريقة التنبؤ السابقة فإننا نعبّر عن ذلك بالحدس على الرغم من اختلاف طريقتي التفكير في الحالتين السابقتين. وكيل الصرافة لن يقول بالتأكيد بأن التنبؤ تم باستخدام نماذج السوق المالي لعدم توافر أية معادلة رياضية مكتوبة. ولكنه من جهة أخرى استخدم بشكل ضمني شكلاً من أشكال النماذج، فلو كان هذا العامل قد استند في تنبئه المتفائل إلى معدلات النمو السابقة للمؤشر نفسه، يكون بذلك قد استخدم نموذجاً للتمديد الخارجي لسلسلة زمنية. ولو استند في تنبئه إلى معرفة العلاقات بين هذا المؤشر والمتغيرات الاقتصادية الكلية يكون بذلك قد استخدم نموذجاً من نماذج الاقتصاد القياسي.

ولو عدنا للتنبؤ الحدسي فإن القائم على التنبؤ يستخدم دون أن يعلم نماذج ضمنية عند إجرائه للتنبؤ. ومن ثم فإن السؤال المطروح هو لماذا نستخدم هذه النماذج بشكل صريح (غير ضمني) ونعمل على تقديرها واختبارها إحصائياً ولا نكتفي بالاستخدام الضمني لها؟ هناك العديد من الأسباب التي تدعو إلى ذلك.

أولاً، إن استخدام النماذج في عملية التنبؤ يثبت بشكل واضح العلاقات التحتية المتداخلة ويعمل على تقديرها إحصائياً، بالإضافة إلى ذلك فإن الاستخدام الحدسي من أجل التنبؤ يمكن أن يتجاهل بعض العلاقات المهمة أو يؤدي إلى استخدام غير صحيح لها.

كما أن هناك بعض العلاقات الهامشية ولكنها تفسيرية وموجودة في النموذج الإجمالي يجب اختبارها والتحقق من صلاحيتها إحصائياً ورضعها في مكانها الصحيح وهذا بالتأكيد غير محقق مع التنبؤ الحدسي.

أخيراً، من الضروري، بالإضافة إلى التنبؤات التي سنحصل عليها، أن نعطي درجة من الثقة لتلك التنبؤات: كي يستطيع المستخدم استعمالها أي أن نحدد مقدار الدقة

المعطاة لتلك التنبؤات، وفي هذا الإطار فإن استخدام طرائق التنبؤ الحدسى لا يعطى أى مقاييس كمية لجودة التنبؤ.

### محتوى الكتاب:

ينقسم هذا الكتاب إلى ثلاثة أجزاء. نعالج فى جزئه الأول الحاجة للتنبؤ سواء المعبر عنها أو غير المعبر عنها، ذلك أن بعض المنشآت تعاني صعوبة تحديد الصفات المختلفة لحاجة التنبؤ. فهى قد تخلط غالباً ما بين التنبؤ وبين الهدف الذى تأمل تحقيقه من عمل المنشأة وترغب فى أداة معجزة تسمح لها بالتنبؤ على كل المجالات الزمنية.

تعرض الفصول الثلاثة التالية المفاهيم الأساسية للسلاسل الزمنية وللطرائق الأساسية المستخدمة فى المعالجة الإحصائية، إما من خلال عملية التمديد الخارجى Extrapolation للسلسلة الزمنية أو من خلال اللجوء إلى السلاسل الزمنية التفسيرية.

يخصص الجزء الثانى من هذا الكتاب لطريقة التنبؤ القطاعى وتختلف النماذج المستخدمة هنا من قطاع إلى آخر وتتناسب مع ميزات هذا القطاع. لذلك نعالج الفصول المتعلقة بهذا الجزء التنبؤ فى القطاع الصناعى وفى قطاع السلع الاستهلاكية العمرة وفى قطاع السلع ذات الاستهلاك الكبير. وسيكون هناك فصل مخصص لمعالجة البيانات الضوئية المأخوذة من مشتريات المستهلكين فى المجمعات التجارية الكبرى من أجل التنبؤ بتأثير السياسات المختلفة المتعلقة بالتسويق. كما سيتم إجراء معالجة خاصة لبعض الحالات الخاصة المتعلقة بالتنبؤ مثل التنبؤ على المجال الزمنى القصير جداً (يوم، أسبوع) فى قطاع الخدمات أو فيما يخص المنتجات الطازجة وكذلك المسائل المتعلقة بالتنبؤ بتشكيلة الملابس الموسمية فى قطاع النسيج.

الجزء الثالث المعنون بـ « إنشاء وتثبيت نظام التنبؤ » يعالج أولاً الأسئلة المتعلقة بالمعطيات المصدر وإدارة السلاسل الزمنية وبكيفية إجراء التحويلات الرياضية عليها. كما يبين بدائل هذا النظام ثم يختبر الحلول المختلفة للمعالجة الآلية ويعرض طريقة لإتمام التنبؤ بواسطة نظام متكامل يكون المستخدم جزءاً منه ويساهم فى تجاربه الأولية بهدف جعل هذا التنبؤ مستخدماً بشكل عملى فى المؤسسة. أخيراً، يخصص الفصل الأخير لإجراءات تقييم أنظمة التنبؤ وإلى اختيار الطريقة الأكثر ملاءمة.

### بماذا يختلف هذا الكتاب عن كتب التنبؤ الأخرى؟

لا بد من الإشارة أولاً إلى عدم اعتبار هذا الكتاب مرجعاً إحصائياً، حيث تم اختصار الجزء النظرى فيه قدر الإمكان، وتم استعراض الآليات الإحصائية المستخدمة من خلال مجموعة من الأمثلة الرقمية المأخوذة من الواقع. بالمقابل فإن استخدام الأدوات

الرياضية كان محدوداً نسبياً واقتصر على بعض المفاهيم المتعلقة بالحساب الاحتمالي التي لا تستلزم معرفة بالجبر المصفوفاتي. ومن المفيد أن يكون القارئ على دراية جيدة بالإحصاء والاحتمالات خصوصاً بالنسبة للفصول (الثالث والرابع والخامس) ويمكنه هنا الاستعانة بالعديد من الكتب والمراجع المتوافرة في قائمة المراجع في نهاية الكتاب. تم، في هذا الكتاب، توضيح المفاهيم النظرية من خلال العديد من الأمثلة والتمارين المحولة بواسطة البرنامج Excel مما يتيح للقارئ إمكانية أكبر في إجراء الحسابات وفي معالجة السلاسل الزمنية.

نرغب من خلال هذا الكتاب إعطاء القارئ (طالب، باحث، اقتصادي منشآت) كل العناصر الضرورية النظرية منها (دون الخوض في التفاصيل) والعملية التي تسمح له بحل المسائل التي تواجهه في معالجة السلاسل الزمنية.

وبهدف إتاحة الفرصة للقارئ نفسه في إعادة حل مجمل تمارين الكتاب، فقد تم عرض المعطيات والتمارين على الشبكة العنكبوتية ويمكن لأي مهتم تحميل هذه المعطيات من خلال الموقع التالي: <http://www.dauphine.fr/cip/pages/bourbonnais>.

بقى أن نشير إلى أن مشكلة تكامل التنبؤ تبرز بقوة أثناء التطبيق لكونها تتعلق بتوفيق معطيات تنبؤية:

- على مجالات زمنية مختلفة. - وتغطي مستويات مختلفة من الحيز الجغرافي.
  - وتتعلق بفئة من المنتجات. - وتشمل طرائق مختلفة من التنبؤ.
- وعوضاً عن معالجة هذه المواضيع بفصل مستقل واحد فقد تم التطرق إليها من خلال مجموعة من الفصول في أقسام جزئية: القسم الخامس من الفصلين الخامس والسادس والقسم الثالث من الفصل السابع والقسم الرابع من الفصل الثامن. في حين سنعالج في الفصلين العاشر والحادي عشر وبشكل أكثر عمومية، دمج المجالات الزمنية والمنتجات المختلفة والمناطق الجغرافية والطرائق المستخدمة.

ما يميز هذا الكتاب بشكل أساسي هو هدفه المتعلق بالربط بين العملي (وضع نظام للتنبؤ في المنشأة) والنظري (إنشاء النماذج الرياضية للتنبؤ). وهذه العلاقة منظمة حول اهتمامين: تثبيت أنظمة ثابتة وفعالة داخل المنشأة، عدم الإقلال من أهمية الجانب النظري عند استخدام التنبؤ.

يأمل المؤلفان اللذان لديهما خبرة عملية وجامعية منذ سنوات عديدة بموضوع التنبؤ، تقديم عرض شائق لهذا الموضوع الذي غالباً ما يكون جافاً وتقديم مجموعة من الحلول المناسبة الحقيقية للمنشآت وأن يشكلوا مع فريق الطلاب نصراً جديداً لهذا الموضوع الشائق ألا وهو «التنبؤ».

---

## الجزء الأول

### التنبؤ - الحاجات والأساليب

نستعرض فى الجزء الأول من هذا الكتاب المسائل المتعلقة بالتنبؤ للمبيعات كما تظهر فى المنشأة بهدف تمثيلها واقتراح حلول أولية لها. وسوف نوضح الفرق بين مفهومين غالباً ما يتم الخلط بينهما وهما التنبؤ والهدف الذى تسعى المنشأة إلى تحقيقه. كذلك سوف نفرق بين ما تعانى منه المنشأة وهو يمكن أن يكون هدفاً للتنبؤ، وبين الإجراءات المتاحة لها التى تبقى بشكل كامل فى مجال قرارات الإدارة. وتشكل هذه العناصر السابقة مضمون الفصل الأول.

يخصص الفصل الثانى لاستعراض الأدوات الإحصائية الأولية الأساسية المستخدمة فى مجال التنبؤ (مقاييس القيم المتوسطة والتشتت) وكذلك تحليل السلاسل الزمنية. كما سنبين كيفية تفكيك السلسلة الزمنية إلى مركباتها الأساسية، وكيفية حساب أهم المركبات أى مركبة الاتجاه العام والمركبة الفصلية.

أما بشأن طرائق التنبؤ فسوف نستعرضها فى الفصلين الثالث والرابع وقد تم وضعهما فى فصلين منفصلين بسبب ضخامة الحجم من جهة ولوضوح العرض من جهة أخرى. وقد بدأنا بعرض أساليب الصقل الآسى (الفصل الثالث): كون تلك الأساليب تمثل أولى الطرائق المستخدمة فى التنبؤ، أما فى الفصل الرابع فقد تم استعراض طريقة بوكس وجانكينز والطرائق التفسيرية الأخرى (التي تستخدم مفاهيم السببية الخارجية أى المتغيرات الخارجية) التى تعتبر أكثر تعقيداً من الطرائق الأولى.





## الفصل الأول

### التنبؤ بالمبيعات - بعض الأفكار الأولية

سنوضح من خلال هذا الفصل ماهية العلاقة بين التنبؤ وبين الشكل التنظيمي للمنشأة من جهة وبين التنبؤ والنشاط الذى تمارسه هذه المنشأة من جهة أخرى وبعد ذلك سنوضح كيف يتم إجراء التنبؤ بالمبيعات داخل المنشأة، أى كيف تصاغ المشكلة وكيف نجد الحلول المناسبة لها، ثم سنقترح بعض التعاريف: كى يتم التمييز بين التنبؤ وبين الهدف الذى تسعى المنشأة إلى تحقيقه.

#### ١- لماذا نجرى تنبؤاً للمبيعات؟

يبدو هذا السؤال بسيطاً ولكنه على الرغم من ذلك يستوجب بعض التفكير قبل الإجابة عنه ومن أجل ذلك نعرض النقطتين التاليتين:

##### ١-١- التنبؤ يحدد الحدود المثلى للتمويل:

يعتبر التنبؤ بالطلب العنصر الأساس فى التحديد الأمثل لعناصر الإمداد والتمويل المختلفة فى المنشأة Supply chain Management<sup>(١)</sup>، فمهما كان نمط التنظيم لهذه المنشأة (مرناً وديناميكياً) ومهما كانت درجة تكامله فى انسياب تدفقاته، فإن هناك عنصرين أساسيين لتحديد التمويل الأمثل:

- التنبؤ بالاستهلاك.

- المصادقية المنتظرة من هذا التنبؤ.

يحدد التنبؤ بالاستهلاك - بطريقة مباشرة - جزءاً من مستوى التمويل يغطى الحد الأدنى من الاحتياجات خلال فترة زمنية ما.

أما المصادقية المعطاة لهذا التنبؤ فهي تسمح بتحديد أمثل لمستوى المخزون الاحتياطى الآمن.

---

(١) يقصد بالتعبير Supply chain Management عمليات التنظيم والتخطيط والمراقبة والتنفيذ للتدفقات من السلع بدءاً من مرحلة استخلاص المواد الأولية ومروراً بعمليات الإنتاج وانتهاءً بعمليات التوزيع للمستهلك النهائى بحيث تكون تكاليف المراحل السابقة فى حدودها الدنيا (المترجم).

## ١-٢- إلزامية (ضرورة) التنبؤ مرتبطة بفترة الاستجابة للمنشأة:

ليست كل المنشآت ملزمة بموضوع التنبؤ، على الأقل فى إطار نظام انسياب تدفقاتها. مثال ذلك المنشآت التى تعمل وفق نظام الطلبيات، أى تلك التى تكون فيها فترة التسليم المقبولة لدى الزبائن أكبر من فترة التزود من المواد الأولية من قبل الموردين ومن فترة الإنتاج. وهناك بعض المؤسسات تدخل ضمن هذه الفئة، نذكر منها شركات تصنيع الطائرات والمراكب البحرية. فمن أجل هذه المنشآت ليس هناك وجود لمشكلة التنبؤ القصير والمتوسط الأجل.

وفى الجانب الآخر، هناك العديد من المنشآت التى تعمل فى قطاع الاستهلاك الكبير تكون فيها فترة التسليم عدة أيام أو حتى عدة ساعات (موزعو الأدوية على الصيدليات) ومن ثم فإن المخزون من هذه المنتجات النهائية يجب أن يكون متوافراً وإلا سيكون هناك انقطاعات فى الإمداد، ومن ثم خسارة فى أرقام المبيعات وتشويه سمعة المؤسسة.

ولكى يكون مستوى المخزون فى الشكل الأمثل لا بد من إجراء التنبؤ بالطلب.

يمثل الجدول (١) القرار الذى يواجه المنشأة وعليها اتخاذ: مرونة فى أدوات الإنتاج أم تخزين. فغالباً ما يتم البحث عن حل لمشكلة تنبؤ ما ويكون حلها بديلاً من خلال زيادة الديناميكية و/أو المرونة فى وسائل الإنتاج لتغطية الطلب المطلوب. ولكن هذه الإمكانية ليست دائماً متاحة وترتبط بمدد التسليم التى يطالب بها الموردون.

الجدول رقم (١) لماذا التنبؤ؟

تمويل المواد الأولية	التصنيع	التغليف المخصص	المخزون
حسب الطلب	حسب الطلب	حسب الطلب	بدون مخزون
بالتنبؤ	حسب الطلب	حسب الطلب	مواد أولية
بالتنبؤ	بالتنبؤ	حسب الطلب	منتجات نصف نهائية
بالتنبؤ	بالتنبؤ	بالتنبؤ	منتجات نهائية

## ٢- خصائص مشكلة التنبؤ:

تستند الخطوة الأولى فى التنبؤ إلى توضيح خصائص هذا التنبؤ، ونظراً لتعدد هذه الخصائص فمن المفيد إجراء تصنيف شامل لوسائل التنبؤ وفقاً لبعض العوامل المؤثرة

فيه مثل: المجال الزمنى المعتبر، ونوع المنتج، وقطاع النشاط، وكذلك تبعاً للهدف العملى للتنبؤ. من أجل ذلك نعلم الخطوط العريضة التالية التى تميز بين تنبؤ وآخر، وهى:

- قطاع النشاط الذى تمارسه المنشأة.
- الاستخدام العملى.
- الجهة أو الجهات التى تستخدم التنبؤ.
- المجال الزمنى الذى يغطيه التنبؤ.

فمما لا شك فيه أن التنبؤ يرتبط بقطاع النشاط الممارس من قبل المنشأة، فالتنبؤ بمواعيد تسليم مادة الأسمنت لا يتم بالطريقة نفسها لمبيعات مادة الصابون. وهنا تختلف السببية الاقتصادية التحتية تبعاً لكون القطاع قريباً أو بعيداً من قمة الدورة الصناعية، ومن ثم أقل أو أكثر قرباً من الطلب النهائى، كما تختلف أيضاً تبعاً لكون المنتج قابلاً للتخزين أو لا، أو تبعاً لكونه يشكل سوقاً قابلة للتجديد والتحديث (سوق التلفزيون) أو لا (سوق الفولاذ)، كما تختلف أيضاً تبعاً لكون المنتج معيارياً أو لا. كل هذه العناصر تلعب دوراً فى تعريف النماذج المستخدمة للتنبؤ فى القطاعات الثلاثة التى سيتم معالجتها فى هذا الكتاب فى فصول الجزء الثانى (التنبؤ القطاعى).

ويمكننا هنا أن نميز بين:

- قطاع المنتجات الصناعية الوسيطة (فولاذ، منتجات كيميائية، مواد إنشائية) المرتبطة بشكل كبير بالحالة الاقتصادية العامة وبتطور الطلب عليها فى القطاعات الكبيرة (البناء، السيارات، ...)، ويكون تأثير المنشأة فى السوق فى هذه الحالة محدوداً جداً، وينحصر التنبؤ فى معرفة متى سيحدث التغير فى الوضع الاقتصادى (الانتقال من النمو إلى الركود أو العكس).
- قطاع المنتجات ذات الاستهلاك الكبير التى يكون تأثير الوضع الاقتصادى العام عليها ضعيفاً بعكس المجموعة السابقة، ولكن فى المقابل هناك تأثير كبير للبيئة التنافسية. ومن ثم فإنه يجب التنبؤ بتحديد ما ستكون عليه المبيعات مع الأخذ بعين الاعتبار الإجراءات التسويقية للمنشأة ولتنافسيها.
- تأتى مجموعة السلع الاستهلاكية المعمرة (السيارة، الأدوات الكهربائية المنزلية، التلفزيون، ... إلخ) باعتبارها حلاً وسطاً بين المجموعتين السابقتين، إذ تتميز بحساسيتها لكل من الحالة الاقتصادية العامة وللمتغيرات التسويقية (جهود الدعاية وتأثيرات الموسعة، على سبيل المثال) ولهذه المجموعة من السلع طرائق تنبؤ مختلفة.

وما يميز هذه الأسواق هو الحضور المتلازم للطلب الأولى من المنتج ولطلب التجديد أو التحديث.

يشير الجدول (٢) إلى الاستخدامات الأساسية للتنبؤ دون الأخذ بعين الاعتبار قطاع نشاط المنشأة أى تبعاً:

- لطبيعة عمل المستخدم.
- ولل مجال الزمنى للتنبؤ.

الجدول رقم (٢) مجالات استخدام التنبؤ<sup>(a)</sup>

المجال الزمنى	الاستخدام	طبيعة العمل
٣ إلى ٦ أشهر	تنبؤ بالمبيعات - تحديد الأهداف	إدارة تجارية
١ إلى ٩ أشهر	تنبؤ بالطلبات والتسليم والتمويل	التمويل وإدارة الإنتاج
٦ إلى ١٢ شهراً	تنبؤ بالمبيعات - خطة التسويق	التسويق
١٥ إلى ١٨ شهراً	تنبؤ بالميزانية - تنبؤ بالخزينة	الشؤون المالية والمراقبة الإدارية
٢ سنوات أو أكثر	تنبؤ وتخطيط إستراتيجى	التخطيط

(a) الفترة الزمنية للتنبؤ المشار إليها ليست إلا مثلاً وهى ترتبط بشكل كامل بقطاع النشاط الممارس.

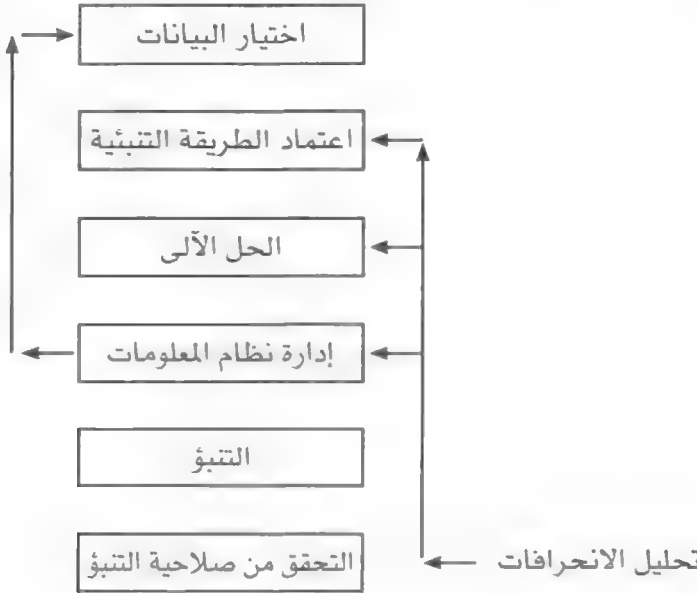
لا يعطى الجدول السابق إلا ملخصاً مبسطاً للمجالات الزمنية للتنبؤ وهذه المجالات يمكن أن تكون أيضاً قصيرة جداً:

- تنبؤات ساعية ليوم أو لبضعة أيام (الخدمات الطبية الإسعافية، عمليات دفع الرسوم على الطرقات السريعة، حالات المرور على الصندوق فى المخازن التجارية الكبرى).
- تنبؤات يومية لأنشطة الخدمات (مطاعم، فنادق، سينما، تجميع الأفلام الفوتوغرافية).

### ٣- مواصفات الحل التنبؤى:

الوصول إلى نظام للتنبؤ يتضمن عدداً محدداً من العمليات كما هو مبين فى المخطط ١. فعندما نكون بصدد مشكلة تنبؤية فى منشأة ما، علينا التحقق من مجموعة من العناصر التى تلعب دوراً فى اختيار الحل.

الرسم التوضيحي رقم (١) خطوات الوصول للحل التنبؤي



### ٣-١- البيانات الواجب التنبؤ بها:

تمثل البيانات التاريخية السابقة المتوافرة حول الظاهرة المدروسة نقطة الانطلاق الأساسية والمهمة التي تخدم أساساً للتنبؤ. وغالباً ما نلجأ إلى معطيات تسليم البضاعة كون هذه المعطيات سهلة من ناحية الحصول عليها بواسطة الفواتير. ولكن لهذه المعطيات سلبية كبيرة تتمثل في كونها تتأثر بانقطاعات المخزون ومن ثم لا تكون ممثلة بشكل جيد للطلب الحقيقي. من هنا يمكن الاستعانة بالطلبات باعتبارها أساساً للبيانات: حيث تكون الأقرب إلى الطلب الحقيقي النهائي، ويجب أن تكون هذه الطلبات مربوطة بالمصدر حتى يمكن أن تكون مؤرخة زمنياً.

ولكن لسوء الحظ هذه المعلومات في كثير من الأحيان لا تكون متوافرة لأسباب تتعلق بعدم تجانس المعطيات على الفترة الزمنية المدروسة أو بسبب استثناء تسجيل المعطيات المتعلقة بمنتج أو مستورد ما محسوب على السوق أو لعدم حفظ المعلومات على وسائل حديثة.

إن عدد المشاهدات الواجب أخذها بعين الاعتبار لإجراء التنبؤ يجب أن:

- لا يكون قليلاً جداً، فمن أجل حساب المعاملات الفصلية يجب أن يتوافر لدينا عدد من المشاهدات يغطي على الأقل ثلاث سنوات (يفضل أربع سنوات).
  - لا يكون كبيراً جداً (خمس سنوات حداً أقصى).
- هناك الكثير من الأسباب التي تجعل المعطيات غير كافية لإجراء التنبؤ، ومن ثم يكون واضحاً منذ بداية التحليل أن الحل لمشكلة تنبؤية ما غير ممكن إذا لم تتوافر البيانات اللازمة لذلك.

### ٣-٢- الفترة الفاصلة بين بيانات التنبؤ (تردد البيانات) والمجال الزمني للتنبؤ:

- نقصد بتردد البيانات *Périodicité* الفترة الزمنية الفاصلة بين مشاهدة وأخرى وتختلف هذه الفواصل الزمنية تبعاً لنشاط المنشأة ولنوع المنتج:
- فمن أجل المنتجات الصناعية أو منتجات الاستهلاك الجارى تكون المعطيات الشهرية كافية ويكون مجال التنبؤ محصوراً بين ستة وثمانية عشر شهراً.
  - ومن أجل المنتجات الطازجة، لا تفي المعطيات الشهرية بأغراض التنبؤ ويستخدم عوضاً عنها معطيات أسبوعية تعكس التقلبات السريعة في مثل هذا النوع من المنتجات. أما مجال التنبؤ فيمكن أن يمتد إلى (١٥) أسبوعاً.
  - وأخيراً من أجل بعض الخدمات (كافتتاح صندوق محاسبة جديد في مخزن تجارى أو مركز لجباية الرسوم من المركبات عند استخدامها للطرق السريعة) أو بعض المنتجات الطازجة جداً، يفضل استخدام المعطيات اليومية أو حتى الساعية حيث تكون إمكانية التخزين لهذه المنتجات ضعيفة ويتغير الطلب اليومي عليها بشكل كبير.
- أما ما يخص المجال الزمني للتنبؤ، فإن التحديد الدقيق الممكن لنمط النشاط اليومي يعتبر الأساس في ذلك ومن ثم فإن مجال التنبؤ يمكن أن يكون محدداً ببضعة أيام (عملياً، نحو الثلاثين يوماً تقريباً).

### ٣-٣- كيفية اختيار الطريقة المناسبة:

بعد الانتهاء من المرحلة السابقة تأتي مرحلة البحث عن الطريقة المناسبة للتنبؤ، إذ يوجد تقنيتان اثنتان ممكنتان هما:

- التقنية الأولى وهى تستند إلى ما يسمى بطرائق التمديد الخارجى *extrapolitives* المسماة ضمن هذا الكتاب بالطرائق الداخلية *endogènes*، وتستند إلى فكرة عزل عدد محدد من مركبات السلسلة الزمنية المدروسة وتمديد السلسلة المتبقية نحو المستقبل المراد التنبؤ به.

- تسمى التقنية الثانية وهى تسمى بالطرائق التفسيرية explicatives وتسمى أيضاً بالطرائق الخارجية exogènes وهى تبحث عن علاقات بين السلسلة المراد إجراء التنبؤ بها وسلاسل أخرى تفسيرية. من أجل ذلك يتم حساب معاملات الارتباط بين السلسلة الأولى والسلاسل الأخرى التفسيرية.

يمكن للطريقة المناسبة أن تكون أحياناً خليطاً من النمطين السابقين ولكنها تبقى تابعة لقيود تتعلق بنمط المعطيات وفى حال عدم وجود أى عامل تفسيري متاح: فإننا فى هذه الحالة نستخدم طريقة التمديد الخارجى.

### ٣-٤- الحل الآلى ونظام المعلومات:

أردنا عرض هذين المفهومين (الحل الآلى ونظام المعلومات) معاً للعلاقة التى تربط بينهما فى كثير من الأحيان عند التنفيذ. هناك عرض كبير من البرمجيات الجاهزة. منها ما هو مخصص لموضوع التنبؤ بالمبيعات ومنها ما يعالج مسائل أكثر شمولية تتعلق بإيجاد الحلول المثلى للعملية التكاملية للإمداد والتموين (Supply chain). وغالباً تفترض هذه البرمجيات وجود إدارى يُعنى بقواعد المعطيات مما يساعد فى تكوين مكتب لنظام المعلومات التسويقية والتجارية لدى المنشأة.

ويتعلق اختيار البرنامج المناسب لإجراء التنبؤ بطبيعة عمل المنشأة وبآلية تنظيمها وبقطاع نشاطها.

### ٣-٥- التنبؤ ومدى صلاحيته:

فى هذه المرحلة يتم إنشاء النموذج الرياضى للتنبؤ وهو يستند إلى معطيات المراحل الأربع السابقة ونجرى محاكاة Simulation لهذا النموذج ومن ثم نعرض التنبؤات الناتجة. تفترض عملية إنشاء النموذج تعريفه بشكل صحيح ثم ضبطه على المعطيات السابقة. أما محاكاة النموذج فتعنى أن نأخذ جزءاً من المعطيات السابقة المعلومة للسلسلة المدروسة ونخفى قيمها، على سبيل المثال الأشهر الستة الأخيرة أو السنة الأخيرة، ومن ثم نجرى تجربة للتنبؤ بواسطة النموذج المختار ومن ثم مقارنة النتائج بالقيم الحقيقية.

التنبؤ الناتج هنا يأخذ بعين الاعتبار بعض المفاهيم الإحصائية الصرفة (الجودة الإحصائية للنموذج) ومفاهيم اقتصادية أخرى (معنوية المتغيرات المدروسة وتأثيرها فى النموذج مقارنة بما يوحى إليه الواقع) وكذلك جودة عملية المحاكاة للفترة المختارة.



يتم فى المرحلة الأخيرة إدخال التنبؤ إلى المنشأة ومن ثم التحقق من صلاحيته.

وفى حال وجود اختلافات جوهرية بين نتائج التنبؤ الرياضية ونتائج التنبؤ الحدسية فمن الضروري حل أى نزاعات يمكن أن تظهر بين القائمين على التنبؤ الرياضى وأصحاب التنبؤ الحدسى، ويجب عدم إعطاء أهمية كبيرة للنتائج الأولية لنظام التنبؤ، فقد يستلزم النظام عدة أشهر حتى يصبح ممكناً الوثوق به.

يمكن للمراحل السابقة الذكر أن تتكرر أحياناً وذلك كما هو موضح فى الرسم التخطيطى رقم (١) حيث الوصول إلى مستوى معين من الحل التنبئى يستلزم أحياناً العودة إلى مراحل سابقة ومعاودة الكرة مرة أخرى.

إن إعطاء مرحلة من المراحل السابقة أهمية كبرى وإهمال المراحل الأخرى قد لا يؤدى إلى حل تنبئى جيد، كذلك من الضرورى اختيار البرمجيات المناسبة لطبيعة المعطيات، فهناك بعض البرمجيات الفعالة جداً المخصصة لمعطيات غير متجانسة قد تقود إلى نتائج غير دقيقة، كما أن أى نظام للتنبؤ لا يتضمن عدداً كافياً من المستخدمين قد لا يعطى درجة جيدة من الأداء.

#### ٤- تعريف التنبؤ:

##### ٤-١- التنبؤ والهدف المنشود للمنشأة:

على الرغم من الاختلاف الواضح بين هذين المفهومين إلا أن بعض المنشآت غالباً ما تمزج بينهما، وسبب هذا الخلط يعود إلى مسألة البيانات التى تشكل النقطة الأساس فى هذا المزج. فالكثير من المؤسسات ترغب فى التنبؤ بالمعطيات الخاصة بالمنشأة (أرقام المبيعات، الأرباح، الطلبات، ...) وهذا يؤدى إلى الخلط ما بين التنبؤ وبين هدف المنشأة مما يعنى خطراً كبيراً. لذلك من الضرورى التفريق بين ما تعانى منه المنشأة ويمكن أن يكون موضوعاً للتنبؤ وبين ما تتحكم فيه المنشأة وتسيطر عليه من خلال إستراتيجيات محددة تضعها موضع التنفيذ وتستطيع الوصول إليها، أى الهدف.

لهذا السبب يبدو أكثر منطقية التنبؤ أولاً بتقلبات السوق للمنشأة أو التنبؤ بقطاع نشاط المنشأة ومن ثم ترك المنشأة لنفسها تحديد الهدف تبعاً لحصة السوق المتبأ بها.

ولكن فى بعض المنشآت، يعتبر هدف المنشأة والتنبؤ مصدرين للمعلومات التنبؤية متنافسين ومتكاملين.

يُفسر هذا التفريق بين مفهومى التنبؤ وهدف المنشأة بالصعوبات المتولدة عند تحليل الفروقات بين الهدف الكمية للمنشأة وبين التحقق فعلياً. وهذه الصعوبات تظهر عند التنبؤ بمعطيات المنشأة وليس بمعطيات السوق. فمن الصعب معرفة فيما إذا كان أى انحراف سلبى بين القيمتين السابقتين عائداً إلى طريقة غير مناسبة للتنبؤ أو إلى انخفاض فى حصة السوق مما يثير التساؤل حول آلية عمل المنظمة التجارية أو حول جودة المنتج أو مدد التسليم، ... إلخ.

جاء هذا الواقع فإن كلاً يسعى لجعل الفرق بين الهدف وبين التنبؤ فى حدوده الدنيا كي لا ينسب الانحراف الممكن إليه. ولكن طريقة التفكير هذه لا تقود إلى إدارة جيدة، وبهذا المعنى، فإن المنشأة لا تقيّم تطورها النسبى مقارنة بالسوق وبمناقضتها. نعرض فى الرسمين التخطيطيين (٢ و ٣) طريقتى التفكير الممكنتين وفقاً لمدى توافر البيانات.

الرسم التوضيحي رقم (٢) عند توافر بيانات عن السوق



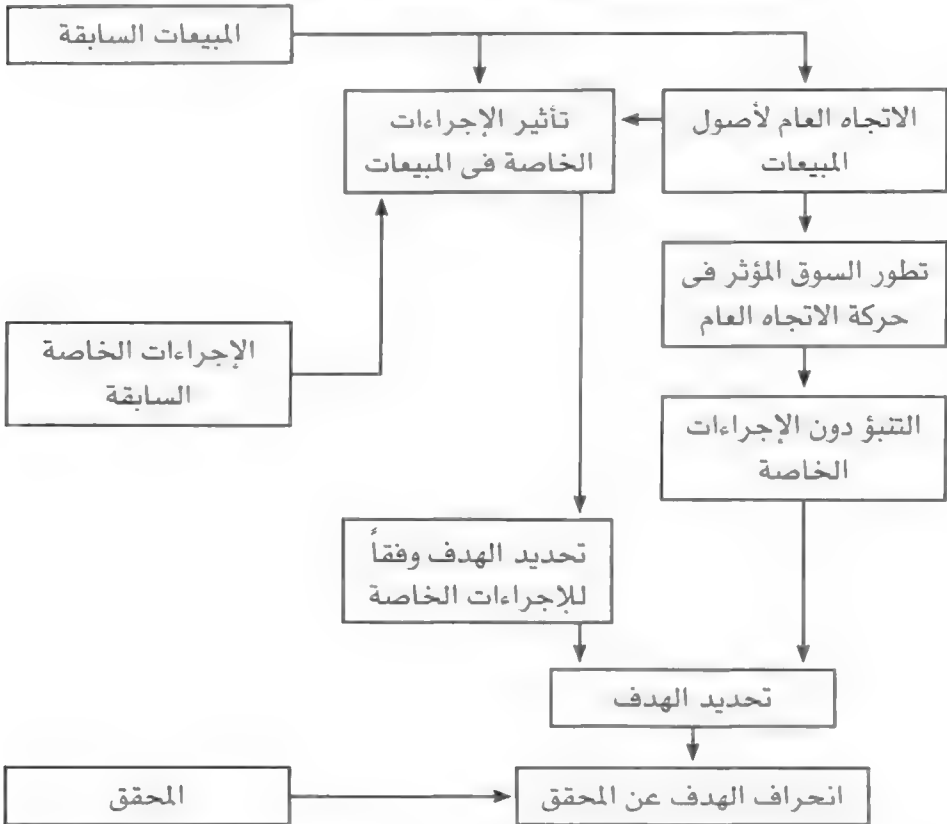
يمكننا من خلال الرسم التوضيحي (٢) السابق أن نميز بشكل واضح بين ما يمكن أن يعود إلى تطور بيئة السوق (والى الخطأ المرتكب من قبل المتنبئ) وبين ما هو مرتبط بعدم تحقق الهدف الكمية المخطط من حصة السوق.

وفى حال عدم توافر بيانات دقيقة عن السوق، كما هو الحال فى كثير من الحالات، فإنه يجب إجراء التنبؤ بالمبيعات دون الأخذ بالإجراءات التى تقررها المنشأة بشكل إرادى (الرسم التوضيحي ٣).

نلاحظ من خلال الرسم التوضيحي (٢) أن العملية تبدأ بإجراء تحليل لبيانات المبيعات للسنوات السابقة بهدف التمييز بين الحصة العائدة لحركة الاتجاه العام لأصول المبيعات وبين الحصة العائدة للإجراءات التسويقية الخاصة بالمبيعات. وهذه الأخيرة يمكن أن تشمل الزيادات في التعرف، عمليات الترويج الدعائي ونفقات الإعلان (هذه العناصر تشكل الفعل الإرادي للمنشأة). أما حساب تأثير تلك العوامل في المبيعات فسيكون من خلال وسائل مختلفة سنعرضها فيما بعد.

يجب بعد ذلك تحليل بعض الظواهر التي يمكن أن تغير في اتجاه حركة الاتجاه العام وهذه الظواهر تشمل دورة حياة المنتج، التقلبات في عادات المستهلكين، التشريعات الضريبية الجديدة، .... إلخ. وهذا التحليل يسمح بالحصول على التنبؤ دون (خارج) تأثير الإجراءات الخاصة بالمنشأة.

الرسم التوضيحي رقم (٣) تحديد الهدف عند غياب بيانات عن السوق



بعد ذلك تقوم المنشأة بتحديد برنامجها المتضمن إجراءاتها التسويقية الخاصة للأشهر القادمة وهو يعتبر هدفاً إرادياً أمام المنافسين الآخرين في السوق. ودمج الإجراءات الأخيرة مع التنبؤ المستقل عن الإجراءات الخاصة للمنشأة ينتج هدف كمي يقارن بالمتحقق فعلياً للوصول إلى الانحراف. تفسير هذا الانحراف يكون صعباً مقارنة بالحالة السابقة حيث يتوافر بيانات عن حصص السوق. فيجب هنا أن يتضمن التحليل التفريق بين العوامل الخارجية التي يمكن ألا تكون مأخوذة بعين الاعتبار (التغير المناخي خلال شهر أو شهرين على سبيل المثال) والتي تساهم في الانحراف عن تنبؤ السوق. وبين العوامل المرتبطة بالإجراءات الخاصة المتخذة من قبل المنشأة، إذ يمكن لبعض هذه الإجراءات ألا تكون محققة أو أن جودة إحداها (الحملة الإعلانية مثلاً) لم تكن عند المستوى المأمول منها أو كذلك يمكن وقوع حدث ما غير متوقع (مثال إلغاء بعض الحسومات عند التوزيع).

#### ٤-٢- بعض التعاريف الأولية:

من خلال ما تم استعراضه حتى الآن يمكن صياغة بعض التعاريف:

##### - التنبؤ بالطلب (تنبؤ بالمبيعات):

التنبؤ بالمبيعات هو التنبؤ بالطلب الفعلي الموجه للمنشأة لفترة زمنية مستقبلية محددة (شهر، سنة، ... الخ) ويتم الحصول على هذا الطلب، بشكل تقليدي، من التنبؤ بالسوق من خلال الهدف المحدد بواسطة المنشأة عن حصتها في السوق.

##### - الأهداف التجارية للمنشأة Objectifs commerciaux:

يختلف هذا المفهوم عن ذلك الخاص بالتنبؤ بالطلب، وتعتبر الأهداف التجارية للمنشأة أداة إنعاش لقوة البيع لدى المنشأة والخلط بينها وبين التنبؤ بالمبيعات يجعل تفكير البائع متحيزاً في تنبؤاته سلباً أو إيجاباً وذلك تبعاً لمزاجه الشخصي كما يجب أن تكون الأهداف التجارية للمنشأة نظرياً أعلى من القيم المتنبأ بها للمبيعات كي تجعل التجار أكثر ديناميكية.

##### - التنبؤ بالتصنيع أو خطة إدارة التصنيع (Plan Directeur de Fabrication):

الاستجابة للتنبؤ بالطلب تتم عبر الصناعة من خلال خطة إدارة التصنيع ويمكن أن تكون هذه الخطة أعلى من الطلب الصناعي المتنبأ به في حال رغبت المنشأة في خلق مخزون جاهز معد بشكل مسبق وقد تكون أصغر في حال ضعف القدرة الإنتاجية للصناعة.

## - برنامج الإنتاج Programme de production :

يعنى برنامج الإنتاج وضع خطة أو مشروع إدارة التصنيع موضع التنفيذ الفعلى من أجل فترة زمنية قصيرة، ويجب أن يكون هذا البرنامج ثابتاً كما يجب التقيد به .

## - ٥- من الذى يقوم بالتنبؤ؟

## ٥-١- عملية إعداد التنبؤ:

يختلف الشخص المسؤول عن إعداد التنبؤ من منشأة إلى أخرى. ويمكن بهذا الصدد سرد بعض وجهات النظر للعاملين فى المنشأة حول هذا الموضوع.

- «التجار هم الأفضل لأداء هذه المهمة نتيجة اتصالاتهم الدائمة بالزبائن. ولكن افتقاد أولئك إلى التحفيز مقارنة بأعمالهم الإدارية يجعل آراءهم غير مأخوذ بها».

- «للعاملين فى مجال الأنشطة التسويقية (رجال التسويق) معرفة جيدة بأحوال السوق ولكن للأسف يخلطون بين رغباتهم وبين الحقائق».

- «الممولون بعيدون عن السوق وكذلك عن الزبائن وجل اهتمامهم ينصب على المخزون ويفضلون الانقطاع فى المخزون على المخزون الفائض. ولكن فهمهم للأرقام يكون غامضاً بسبب عاداتهم فى قياس تدفقات المخزون الخارجية. وهؤلاء هم الوحيدون الملزمون حقيقة بإجراء التنبؤات».

هذه الشهادات الثلاث مستوحاة من عقلية كاتبها وتعكس آراءهم وطريقة تفكيرهم. الحل التقليدي لهذه المشكلة يقضى بإعطاء رجل السوق l'homme de terrain (بائعاً كان أو عارضاً أو مديراً إقليمياً...) الذى يمتلك التقنية والخبرة فى مجال التسويق إمكانية إجراء التنبؤ وذلك لأسباب متعددة منها كونه على اتصال مستمر بالمنتج وبالمشتريين ولديه فهم للسوق وبحكم كونه الشخص الأول المهتم بإجراء تنبؤ جيد: لأنه سيكون مسؤولاً عن أى انحراف بين ما يحققه فعلاً فى السوق وبين ما يتنبأ به. ولكن هناك بعض النقاط السلبية لهذا الاختيار، هى:

- كما أشرنا سابقاً من الممكن لهذا المسؤول أن يخلط ما بين التنبؤ والهدف، أى بين تقديره لتطور السوق وبين ما يعتقد أن باستطاعته فعله للزبون.

- هناك أيضاً سلبية أخرى تتعلق بإمكانية لجوء هذا الشخص إلى إجراء تنبؤ هامشى غير صحيح، حيث يكفى أن يقوم زبون ما قبل إعداد تقرير التنبؤ بإجراء طلبية كبيرة

ومهمة أو أن يكون اليوم السابق للتنبؤ قد شهد نشاطاً إيجابياً مميزاً مما ينعكس على تفكير المتنبئ، ومن ثم إعطاء اتجاه تفاؤلي لحالة السوق للأشهر الثلاثة أو الستة القادمة والعكس صحيح. ولقد أثبتت التجربة أن تنبؤات العاملين على أرض الواقع عادة ما تكون متحيزة وبشكل منتظم إيجابياً أو سلبياً وذلك للسببين التاليين:

- المزاج الشخصي لصانع التنبؤ ليس من ناحية كونه متفائلاً أو متشائماً فحسب، إنما أيضاً نتيجة لتفضيلاته حول الانحرافات الموجبة أو السالبة الممكن حدوثها. وهكذا فإنه يمكن لبائع ما أن يضع تنبؤات محافظة جداً بدافع الحيطة والحذر، في حين يمكن لبائع آخر لا يخشى الانحرافات السلبية الانسياق نحو توقعاته.

- يمكن لنظام إدارة التنبؤ أن يكون متحيزاً بشكل ملموس لتنبؤات الأفراد، فعند تخصيص الإمكانات للإدارات الإقليمية للبيع تبعاً للتنبؤ فإنهم سيعملون على جعل التنبؤات متفائلة، في حين أنه في حال كون البدلات والتعويضات مرتبطة بتحقيق الهدف فسيكون لهم رغبة في جعل التنبؤات متشائمة.

نسمى بين قوسين «تنبؤاً» هذا النمط من المعطيات الخليفة، في الوسط بين الهدف الفعلي والتنبؤ الحقيقي. ولا تعتبر النوعية السيئة للتنبؤ سبباً للاتهام بعدم كفاءة صانعي التنبؤ من رجال السوق أو عدم قدرتهم على المساهمة في نظام التنبؤ، بل إن هذه الجودة السيئة للتنبؤ تدين نظام إدارة التنبؤ كله الذي قام بإعطاء بيانات متحيزة ضرورية للتنبؤ.

غالباً عندما تظهر انحرافات كبيرة ومهمة بين التنبؤ والقيم المحققة فعلاً، تحاول المنشأة التوقف عن منح ثقتها لصانعي التنبؤ من رجال السوق الذين سيعتبرون أنفسهم غير مؤهلين مقارنة بالمهمة التي أوكلت إليهم. ونتيجة لذلك ستلجأ المنشأة إلى وسائل أخرى مختلفة لإجراء التنبؤ من خلال الاستعانة بعمل الإحصائيين الذين لن يكونوا متهمين بالتورط في الإدارة الداخلية للمنشأة. تشكل المبيعات لدى هؤلاء سلسلة زمنية ينبغي توفيقها بواسطة نموذج رياضي يكون الأكثر ملاءمة لها.

ولكن الابتعاد عن المرجعية الحقيقية للسوق يقود إلى النتيجة التاليتين:

- سيكون هناك رضا ذاتي من حيث الطريقة الرياضية المستخدمة، فسرعان ما يظهر الاهتمام بصياغة النموذج (كيفية تعريف بنية النموذج واختيار الطريقة الإحصائية المناسبة للتقدير) وسيسيطر بشكل مؤقت على موضوع التنبؤ. ويبقى التنبؤ هو الهدف ولكنه يختفى مؤقتاً أمام وسائل الوصول إليه، فجودة النموذج الإحصائي تعتبر في

حد ذاتها غاية. وفى حال كانت العلاقة بين الاثنين ثنائية ومباشرة فإن ذلك سيقود إلى تنبؤ جيد. فالنموذج الجيد من وجهة النظر الإحصائية هو النموذج الذى يقود إلى تنبؤ جيد ولكن للأسف، تثبت التجارب العملية أحياناً عدم تحقق هذه المقولة. - سيكون هناك افتراق ما بين الإحصائيين والمستخدمين عائد إلى افتقاد اللغة المشتركة بينهم ولغياب العقلانية الرياضية والتفسيرية لبعض منهم والحدسية والضمنية للبعض الآخر. وهذا الابتعاد سيولد الريبة والشك فى النماذج المستخدمة عند حدوث أى انحراف بسيط بين القيم المحققة والقيم المتوقعة.

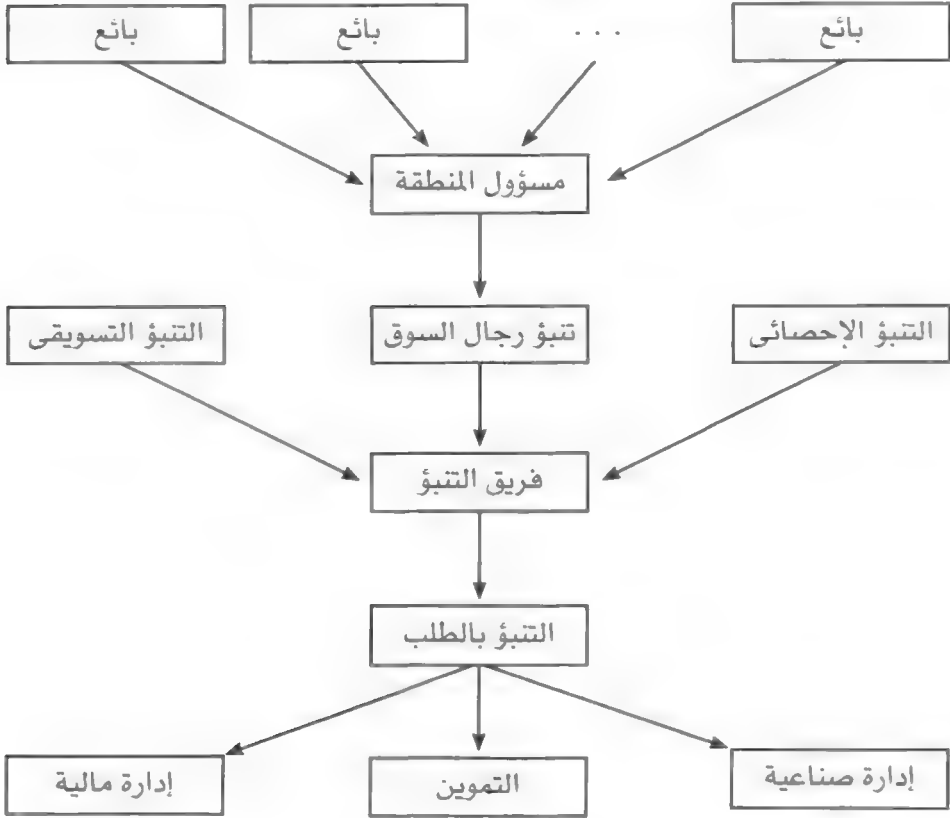
من النادر الوصول إلى نظام تنبؤى ثابت فى المنشأة من خلال الاستخدام الصرف للوسائل الإحصائية فقط وهنا نسأل ماذا يجب فعله أمام هاتين العقبتين؟ الجواب يتلخص فى إجراء تعاون بين هاتين الطريقتين بحيث ننشئ أنظمة تنبؤية لا تقتصر فقط على نماذج للمعالجة الإحصائية، إنما ترتبط أيضاً بالمستخدمين الذين يشركون مع هذه النماذج المتغيرات المعنوية حسب تصوراتهم المرجعية.

فى كثير من الحالات يعتبر التابع المنطقى *la fonction logistique* الأساس فى إجراء التنبؤ ولكن رجال المنطق والرياضيات بعيدون عن السوق، ومن ثم لا يُعتبرون الأفضل لهذه المهمة، ولكنهم ملزمون بتقديم تنبؤات كمية ودقيقة للموردين أو للإنتاج مما يجعلهم مسؤولين فى حال وجود أية مشاكل.

بطريقة مثلى، يجب إعداد التنبؤ بشكل مشترك ضمن فريق يضم مجموع العناصر التى سبق ذكرها. ويكون كل فرد فى الفريق مسؤولاً عن بعض الأرقام، ومن ثم تصبح إمكانية تحميل كل مشاكل التنبؤ لشخص واحد فى حدودها الدنيا. ويوضح الرسم (٤) مثالاً لعملية إعداد التنبؤ.

الغاية من ذلك تتمثل فى امتلاك جميع المعلومات التى يمكن أن تحسن عملية إجراء التنبؤ بالمبيعات ضمن أداة واحدة. حيث يشير جامعو المعلومات (البائعون) من أرض الواقع، بواسطة أجهزتهم الحاسوبية المحمولة، إلى تنبؤاتهم تبعاً لإجراءاتهم الترويجية المخططة، وكذلك إلى كل المعلومات الممكن أن تؤثر فى المبيعات (زبون جديد، تخفيضات، ... إلخ). فيتم توثيق هذه المعلومات على مستوى مركزى وتصبح إمكانية الوصول إليها مباشرة من قبل المسؤول التجارى. بعد ذلك يتم إجراء تطابق بين هذه التنبؤات مع التنبؤات التسويقية والتنبؤات الإحصائية لدى فريق التنبؤ.

الرسم التوضيحي رقم (٤) مثال لعملية إعداد التنبؤ



## ٥-٢- التنبؤ باعتباره أداة مساعدة في اتخاذ القرار:

يتعلق المفهوم السائد حول من يقوم بالتنبؤ بموضوع السحر، فهو يستند إلى حاجة غير معقولة أو غير منطقية نجد جذورها في الأزمنة السابقة. فالتكهن كان من الأمور المتباهى بها في الحضارات الشرق أوسطية القديمة وقد وضعت الديانات حداً لهذه التكهّنات التي كانت تعتبر مرتبطة بالعبادات الوثنية. ويمكن هنا أن نذكر ما وصل إليه أحد القديسين حول خداع المنجمين حيث قال: «لا يوجد على الإطلاق فن للتكهن، وكل تنبؤ صحيح ليس إلا محض صدفة».

من جهة أخرى، يجب تجنب الاستخدام العملي المباشر لنتائج التنبؤ ومن الأفضل اعتبار معطيات التنبؤ وسيلة مساعدة في اتخاذ القرارات وليس بديلاً كاملاً للتفكير



الشخصى. وقد يعتبر الاستخدام المباشر للمعطيات المتنبأ بها خطيراً إذا تم دون التحقق من صحة النموذج المستخدم أساساً للتنبؤ حتى لو كان هذا التحقق أحياناً مختصراً كما هو الحال فى التطبيق المتعلق بإدارة المخزون وعمليات التموين. بالإضافة لما سبق، يمكن تحسين الجودة النهائية للتنبؤ من خلال الربط بين استخدام نظام التنبؤ الرياضى وبين قوة التفكير والتبصر لدى المتنبئ.

هناك نقطتان مشتركتان بين مفهومى التكهّن والتنبؤ، فمن جهة أولى يفى التنبؤ بالحاجة نفسها غير المحدودة لمعرفة المستقبل ومن جهة أخرى ينطلق التنبؤ من الإطار السحرى من خلال استخدامه لأداة رياضية (سحرية) كما هو الحال فى علم التنجيم على الرغم من أن هذا التنبؤ يُبرر بفعاليته من خلال عقلانية الأداة المستخدمة. هناك الكثير مما يتأمله المستخدم من معطيات التنبؤ، وهذا فى ذاته يعد للقائم على التنبؤ تحدياً واضحاً فهو من جهة يعتبر التنبؤ الصحيح ورقة رابحة بيده وفى الوقت نفسه خطراً محققاً به فى حال كانت النتائج الأولى لنظام التنبؤ لا تلبى الحاجة المنتظرة من قبل المستخدم.

يمكن توضيح مساهمة نظام التنبؤ فى النقطتين التاليتين:

- مع مرور الزمن وبعد عدة تجارب فى استخدام التنبؤ يتم تقليص هامش الشك وعدم اليقين فى المستقبل بشكل معنوى. ويمكن التعبير عن ذلك إحصائياً بالقول إن التنبؤ ذو فعالية جيدة ويخفف إلى النصف الانحراف المعيارى لخطأ التنبؤ.
- يساهم نظام التنبؤ أيضاً فى معرفة إمكانية حصول تقلبات فى الحالة الاقتصادية العامة (انتقال من مرحلة النمو إلى مرحلة الركود أو بالعكس) أو فيما إذا كان سيثمر تقلباً حديثاً فى هذه الحالة الاقتصادية أم لا.

أخيراً، يمكن للمنشأة أن تحقق الكثير من الفوائد باستخدام التنبؤ شرط استخدامه بشكل صحيح، ويجب فى كل الأحوال تجنب النظرة التى كانت سائدة سابقاً وهى نظرة تؤدى إلى الشعور بأن التنبؤ هو ما سيصيب حتماً المنشأة، فهو بعكس ذلك يعتبر أداة مساعدة للقرار، أى يجب أن يخدم المنشأة للتحرك فى المستقبل وليس للسيطرة عليه.

## الفصل الثانى

### تفكيك السلسلة الزمنية للمبيعات إلى مكوناتها الأساسية

سنعرض فى هذا الفصل الخصائص التى تتميز بها المعطيات من وجهة النظر الإحصائية وهى تعتبر الأساس فى الدراسات التنبؤية. سنتعرف على مفهوم السلسلة الزمنية ومسارها التاريخى. ومن المعلوم أن التحقق من مدى ملائمة البيانات يعتبر العملية الأولى قبل البدء فى إجراء التحليل أو التنبؤ وذلك لكل الدراسات الكمية.

بعد ذلك سنستعرض بالتفصيل تحليل السلاسل الزمنية ونتعرف على ماهية المشاهدات الشاذة (غير الطبيعية) وكيفية تصحيحها، وكيفية حساب مركبة الاتجاه العام للسلسلة، وكذلك كيفية تخليص السلسلة من التقلبات الفصلية. ومن خلال عرض تفصيلى لآلية تفكيك السلاسل الزمنية، نستطيع تخليص السلسلة من التأثيرات المتكررة، وبعد ذلك يمكننا بسهولة تمديدتها خارجياً لاستخلاص الحد الممثل للبواقى وهو يشكل التقلبات العشوائية للسلسلة.

#### ١- مفهوم المسار التتابعى للسلسلة Historique:

تتكون السلسلة الزمنية من مسار زمنى، أى من متتالية من القيم المرتبة زمنياً بشكل منتظم. فمثلاً فى المؤشر الفرنسى الشهرى لأسعار الاستهلاك المنشور من قبل المعهد الوطنى للبحوث وهو يعتبر سنة الأساس هى عام ١٩٨٠، تمثل متتالية القيم من كانون الثانى ١٩٩٥ إلى أيلول ٢٠٠٠ المسار لهذا المؤشر. كذلك يمكن اعتبار المبيعات الشهرية لمنج ما من آذار عام ١٩٩٧ إلى شباط ٢٠٠٠ مساراً لهذه السلسلة يستخدم من أجل إجراء التنبؤ.

يجب تحقق بعض الخصائص فى المسار لسلسلة زمنية ما منها:

- يجب ألا يتضمن إلا القيم المعلومة والمحسوبة والمحققة فعلاً.
- يجب أن يمثل قيم الظاهرة التى نسعى للتنبؤ بها.
- يجب أن يكون متجانساً مع الزمن، فإذا عدنا إلى مثال مؤشر أسعار المستهلك، نجد كل القيم قد تم حسابها على أساس عام ١٩٨٠ الذى أعتبر سنة الأساس وأعطى القيمة ١٠٠، وقد أتبع طريقة الحساب نفسها والجمع الإحصائى لكل القيم.

- يجب أن يحتوى على حد أدنى من المشاهدات، وكلما ازداد عدد المشاهدات، كانت جودة التوفيق أفضل ومن ثم التنبؤ أفضل. يختلف الحد الأدنى المطلوب لطول السلسلة أى عدد القيم تبعاً للهدف المرجو ولتفريّة المعطيات (الفترة الفاصلة بين مشاهدة وأخرى).

فإذا كان الهدف هو إعطاء تنبؤات لبيانات شهرية للأشهر من (٦) إلى (١٢) القادمة، فإننا نعتبر الحد الأدنى لعدد القيم المطلوبة هو (٣) سنوات أى (٣٦) مشاهدة شهرية فى حين أن الطول المرغوب بشكل عام لمسار سلسلة زمنية ما يتوضع فى حدود (٥/٤) سنوات (خصوصاً عندما يستلزم الأمر حساب معاملات فصلية معنوية).

يسمح هذا الطول بالوصول إلى مستوى مرتفع من المعنوية الإحصائية ويمثل عينة كافية إحصائياً لكى تمثل المجتمع الإجمالى تمثيلاً صحيحاً وتحقق تجانساً اقتصادياً وافياً.

ويعتبر عدد المشاهدات المكونة للمسار تابعاً لفترة تردد المعطيات، ومن ثم فإنه من أجل التنبؤ الأسبوعى للأسابيع الـ (١٥) القادمة يجب الحصول على (١٥٦) مشاهدة أى لمعطيات تغطى (٢) سنوات. وليس مفضلاً الزيادة الكبيرة فى عدد المشاهدات: إذ سيؤدى ذلك إلى تغيرات فى هيكلية السلسلة الزمنية سواء فى مركبة الاتجاه العام أو فى المركبة الفصلية أو فى ظهور ارتباط مع المؤشرات المدروسة، وذلك يمكن أن يؤثر بشكل مضطرب فى التنبؤات القصيرة الأجل.

فى حالة البيانات نصف الفصلية أو الفصلية أو الربع سنوية أو السنوية، يمكننا الاكتفاء بعدد أقل من المشاهدات وذلك لأن البيانات المجمعة غالباً ما تحتوى على كميات كبيرة من المعلومات. مثال ذلك، أن المشاهدة السنوية تعتبر أقل دقة من الـ (١٢) مشاهدة شهرية المكونة لها، ولكنها تحتوى مع ذلك على كمية من المعلومات المتاحة للتحليل أعلى بكثير من تلك المحتواة فى أية مشاهدة شهرية.

لهذا السبب فإن النماذج الاقتصادية القياسية المكونة من معطيات سنوية غالباً ما يتم تقديرها بنحو عشر سنين فى حين يكون غير مناسب تدير نموذج للتنبؤ الشهرى على أساس (١٠) أشهر.

## ٢- حساب المؤشرات الإحصائية الأساسية وتمثيل البيانات:

### ١-٢- حساب المقاييس الأساسية:

نعرض في هذه الفقرة وسائل الحساب الإحصائي البسيطة مثل مقاييس النزعة المركزية ومقاييس التشتت.

#### - المتوسط الحسابي:

الصيغة العامة لحساب المتوسط لسلسلة زمنية مكونة من الحد العام  $x_t$  ولدينا  $n$  مشاهدة هي:

$$\bar{x} = \frac{\sum_{t=1}^n x_t}{n}$$

لا يعطى حساب المتوسط الحسابي إلا فائدة محدودة: إذ من الممكن لسلسلتين مختلفتين من ناحية حركة اتجاههم العام أن يكون لهما متوسطان حسابيان متساويان. كذلك في حالة السلاسل الزمنية ذات حركة الاتجاه العام الصاعدة أو الهابطة، يتغير المتوسط بشكل كبير عند كل قيمة جديدة محققة للسلسلة. لهذا السبب من المفضل أن نعرض بالإضافة للمتوسط الحسابي مؤشراً آخر يسمح بالأخذ بعين الاعتبار قيمة التشتت بين قيم السلسلة.

#### - التشتت:

نستطيع من خلال حساب التباين معرفة مقدار الاختلاف أو التشتت بين قيم السلسلة الزمنية من جهة وبين هذه القيم والقيمة المتوسطة من جهة أخرى ويجب هنا أن نميز بين حالتين، حالة المجتمع الإحصائي بالكامل أو حالة الاكتفاء بعينة ممثلة للمجتمع الأصلي.

صيغة حساب التباين لمجتمع معلوم بالكامل (تباين نظري) ونرمز له بالرمز (Var) هي التالية:

$$Var(x) = \frac{\sum_{t=1}^n (x_t - \bar{x})^2}{n}$$

فى حين أن صيغة حساب التباين لعينة (تباين تجريبى) تعطى بالعلاقة التالية:

$$Var(x) = \frac{\sum_{i=1}^{i=n} (\bar{x}_i - x)^2}{n - 1}$$

فى حالة السلاسل الزمنية للمبيعات نستخدم الصيغة الثانية لحساب التباين: لأننا نهمل القيم الإجمالية للسلسلة وكذلك القيم المستقبلية المحققة إلا تلك التى عادة ما تكون قديمة جداً، ومن ثم تمثل السلسلة الزمنية عينة ممثلة لسلسلة المبيعات الحقيقية غير المعلومة.

فى الأدبيات الإحصائية والاقتصادية، نستخدم الجذر التربيعى الموجب للتباين والمسمى بالانحراف المعيارى  $(\sigma_x)$ :

$$\sigma_x = \sqrt{Var(x)}$$

يعتبر الانحراف المعيارى واحداً من المؤشرات الأساسية الدالة على جودة التنبؤ<sup>(١)</sup>، وله ميزة التعبير عنه بوحدة قياس السلسلة الزمنية نفسها. ولكى نستطيع تفسير قيمته يكون من الأفضل حساب شكله النسبى (نسبة للمتوسط).

#### - معامل الاختلاف:

يعرف معامل الاختلاف بأنه النسبة ما بين الانحراف المعيارى ومتوسط السلسلة المحسوبة من المعطيات الخام:

$$CV = \frac{\sigma_x}{\bar{x}}$$

ويعتبر هذا المعامل مؤشراً لدرجة الصعوبة فى إجراء التنبؤ، فكلما ارتفعت قيمته: كان تباين السلسلة مهماً ومن ثم يكون إجراء التنبؤ مبدئياً صعباً.

ويمكننا تصنيف السلاسل الزمنية للمبيعات من ناحية صعوبة إجراء التنبؤ تبعاً للمعامل السابق على الشكل التالى:

- السلاسل الزمنية ذات معامل الاختلاف أقل من (٠,٥) وهنا يكون التنبؤ مبدئياً سهل التحقق.

(١) فى حال كان الانحراف المعيارى للسلسلة أكبر بشكل معنوى من الانحراف المعيارى لخطأ التنبؤ فإننا نعتبر نظام التنبؤ جيداً.

- السلاسل الزمنية ذات معامل الاختلاف المحصور بين (٠,٥ و ١) وهنا يكون للسلسلة تشتت متوسط، ومن ثم تكون هناك صعوبة متوسطة في إجراء التنبؤ.
  - السلاسل الزمنية ذات معامل الاختلاف أكبر من الواحد ويكون تباين السلسلة المنسوب للمتوسط الحسابي كبيراً ومن ثم يصعب إجراء التنبؤ صعوبة واضحة.
- ولكن لا يمكن لمعامل اختلاف سلسلة المبيعات الخام أن يحكم بشكل مسبق وكامل على الصعوبات اللاحقة، فقد يكون لسلسلة ما تقلبات كبيرة مفسرة بواسطة معاملات فصلية واضحة أو بواسطة عامل تفسيري ما مؤثر جداً في السلسلة.

## ٢-٢- تمثيل البيانات:

الإجراء الأول الذي يلجأ إليه القائم على التنبؤ هو تمثيل السلسلة الزمنية للمبيعات بيانياً، أي الحصول على ما يسمى المنحنى الممثل للظاهرة المدروسة. وهذا الإجراء يسمح للمتنبئ بتفحص تطور السلسلة واكتشاف وجود حوادث ممكنة في السلسلة تقود إلى بروزات أو انخفاضات مهمة، وكذلك استخلاص الحركة العامة لاتجاه السلسلة أو ما يسمى بالنزعة.

ولكى يكون العرض البياني للسلسلة أكثر وضوحاً، يمكن للباحث إجراء تحويل ما على قيم السلسلة أو تطبيق ما يسمى بالمصفى (الفلتر). إن استخدام التحويل اللوغاريتمي<sup>(١)</sup> يؤدي إلى سحق القيم المرتفعة من السلسلة ومن ثم جعلها ممثلة بمقياس أكثر ضيقاً، ويستخدم هذا التحويل عادة للسلاسل المتأثرة بنزعة قوية جداً. وبالنسبة للرسم البياني يكون التمثيل عبر المقياس نصف اللوغاريتمي.

أما تطبيق الفلتر فيعني حساب سلسلة جديدة (تسمى السلسلة المفلترة) من السلسلة الأصلية بواسطة استخدام سياق ديناميكي. وبينما يمكن في حالة السلاسل المحولة العودة من جديد إلى القيم الأصلية للسلسلة (على سبيل المثال استخدام التحويل الآسي للعودة إلى البيانات التي سبق أن تم تحويلها لوجاريتمياً) فإنه يكون من المستحيل إعادة حساب القيم الأصلية للسلسلة بعد تطبيق الفلتر حتى لو كان نوع الفلتر المستخدم معروفاً.

الفلتر الأكثر استخداماً هو فلتر الوسط المتحرك (Moyenne Mobile (MM الذي يعمل على تسوية (صقل) البروزات والانخفاضات الظاهرة في السلسلة كي يمكن

(١) هنا يجب الانتباه إلى القيم السالبة والمعدومة.

الاستدلال بشكل أوضح على حركة الاتجاه العام للسلسلة، ويقوم هذا الفلتر بحساب المتوسط لعدد محدود من قيم السلسلة وتطبيقها على شهر ما.

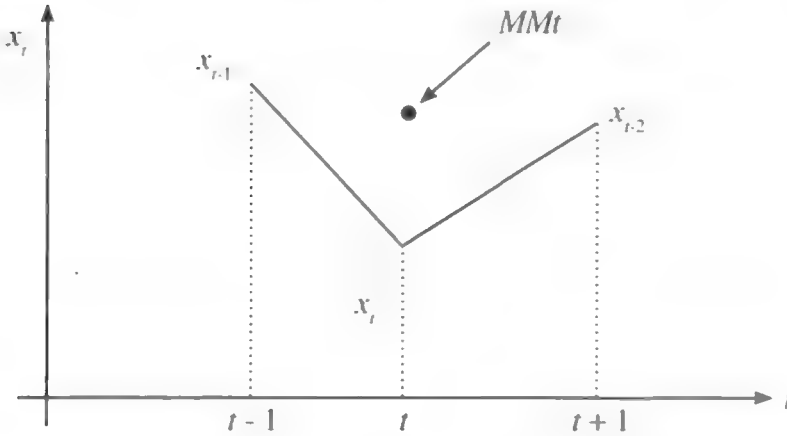
فإذا كان  $x_t$  يمثل الحد العام للسلسلة الخام ولتكن  $t$  تمثل الفترة المقابلة لشهر أكتوبر للعام ٢٠٠٠، فإن للسلسلة المفلترة  $MMt$  من الدرجة الثالثة التي يتم الحصول عليها باستخدام الوسط المتحرك الصيغة التالية:

$$MMt = (x_{t-1} + x_t + x_{t+1})/3$$

يشار إلى أن الوسط المتحرك من الدرجة ٣ لا يمكن حسابه إلا من أجل  $t = 2$  إلى  $n = 1$  (حيث  $n$  تمثل عدد المشاهدات)، وذلك لأنه لا يوجد لدينا مشاهدات قبل  $x_1$  وبعد  $x_n$ .

نلاحظ من الشكل البياني ١ أن الوسط المتحرك يتوضع في المركز المتوسط للنقاط الثلاث.

الشكل البياني رقم (١) وسط متحرك من الدرجة ٣



يتعلق اختيار درجة الوسط المتحرك بالهدف المراد تحقيقه وكلما كانت الدرجة كبيرة: أدى ذلك إلى صقل أكثر للسلسلة المدروسة، ومن ثم محو الظواهر القصيرة الأجل وبقاء حركة الاتجاه العام. كما تؤدي زيادة درجة الصقل إلى خسارة كبيرة للمعلومات الموجودة في بداية ونهاية السلسلة الزمنية. يمكن الإشارة هنا بشكل خاص إلى الوسط المتحرك من الدرجة ١٢ الذي يمثل تطور الاستهلاك أو المبيعات للسلاسل الزمنية الشهرية بدون الظواهر الموسمية.

فى المنشورات والدوريات الإحصائية والاقتصادية (مثل التقرير الشهرى الإحصائى لمعهد البحوث العلمية BMS<sup>(١)</sup> أو الاقتصادى الجديد ...) يتم الاستعانة بالوسط المتحرك من الدرجة ٢ أشهر للتمثيل البيانى للظواهر المفترقة، وذلك لجعل المنحنى أكثر صقلاً ولمحو التقلبات التى تظهر من شهر إلى آخر وتشكل قيمياً متطرفة.

العلاقات العامة لحساب الوسط المتحرك هى التالية:

- فى حال كانت الدرجة تمثل عدداً فردياً  $(٢m + ١)$ :

$$MMt = \frac{1}{2m + 1} \sum_{i=-m}^{i=m} x_{t+i}$$

- فى حال كانت الدرجة تمثل عدداً زوجياً  $(٢m)$ ، فيجب اللجوء إلى طريقة حساب اصطناعية بهدف توافق الحد المركزى  $x_t$  مع قيمة الوسط المتحرك  $MMt$ :

$$MMt = \frac{1}{2m} \left[ \frac{1}{2} x_{t-m} + \sum_{i=-m+1}^{i=m-1} x_{t+i} + \frac{1}{2} x_{t+m} \right]$$

أسباب تبسيط الحساب. نرى من الأفضل اعتبار الأوساط المتحركة من الدرجات الفردية.

نغرض فى الجدول رقم (١) مثلاً لحساب وسط متحرك من الدرجة (٢) ومن الدرجة (٦)، وكذلك حساب المتوسط الحسابى والانحراف المعيارى ومعامل الاختلاف.

الجدول رقم (١) مثال لحساب الأوساط المتحركة ومعامل الاختلاف (الملف على الإنترنت: C2EX1.XLS)

الزمن	الاستهلاك	$MM٢$	$MM٦$
١	١٠٠	-	-
٢	٨٩	٩٦	-
٣	٩٩	٨١,٢٢	-
٤	٥٦	١٠٠,٦٧	٩٢,٦٧
٥	١٤٧	٩٦,٦٧	٩٣,٢٥

(١) التقرير الشهرى للإحصاء فى المعهد الوطنى للعلوم الاقتصادية Insee.



تابع - الجدول رقم (١).

الزمن	الاستهلاك	MM٢	MM١
٦	٨٧	٩٦,٦٧	١٠١,٥٠
٧	٥٦	٩٤,٢٣	١١٣,٨٣
٨	١٤٠	١١٤,٣٣	١١٨,١٧
٩	١٤٧	١٤٧,٦٧	١١٨,٤٢
١٠	١٥٦	١٣٤,٠٠	١٢٦,٣٣
١١	٩٩	١٣١,٠٠	١٣٩,٢٥
١٢	١٣٨	١١٢,٣٣	١٤٩,٢٥
١٣	١٠٠	١٦٣,٠٠	١٤٩,٢٥
١٤	٢٥١	١٦٩,٠٠	١٤٨,٤٢
١٥	١٥٦	١٨٤,٦٧	١٤٨,٠٠
١٦	١٤٧	١٣٣,٦٧	١٤٩,٩٢
١٧	٩٨	١٢٦,٣٣	١٤٦,٦٧
١٨	١٣٤	١١٩,٦٧	-
١٩	١٢٧	١٤٨,٦٧	-
٢٠	١٨٥	-	-
المتوسط الحسابي	١٢٥	١٢٥,٠٠	١٢٨,٢١
الانحراف المعياري	٤٤,١١	٢٨,٢٨	٢١,٠٩
معامل الاختلاف	٠,٣٥	٠,٢٣	٠,١٦

مثال في الحساب للجدول السابق:

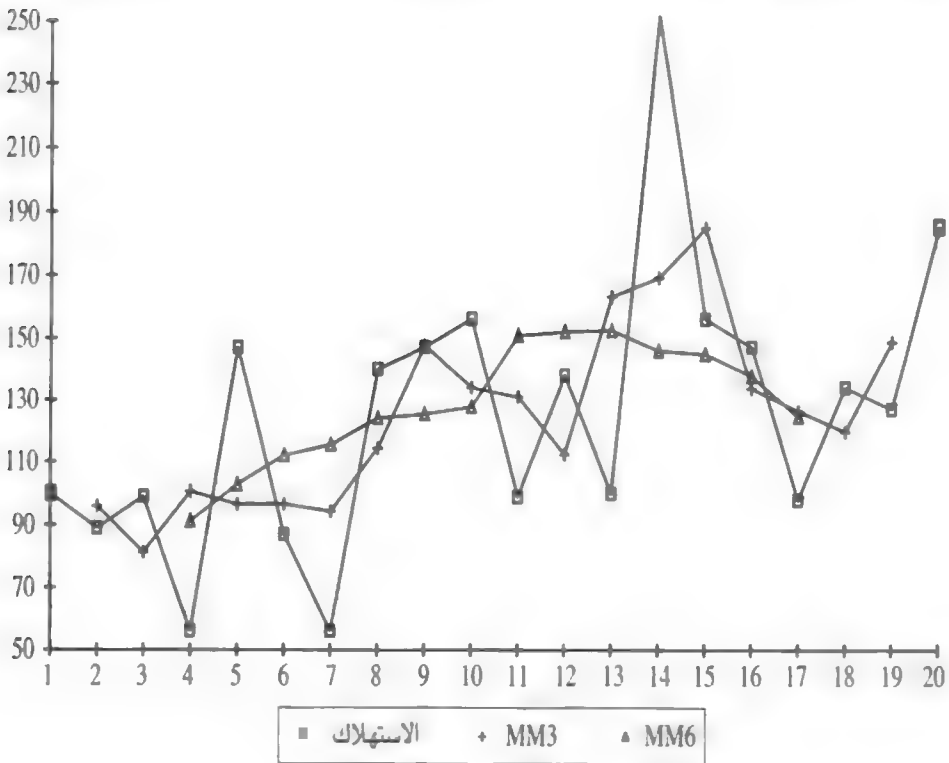
من أجل  $t = 10$  (حساب الوسط المتحرك من الدرجة ٣ ومن الدرجة ٦ عند الفترة الزمنية الثانية)

$$MM3_{10} = (147 + 156 = 99)/3 = 134$$

$$MM6_{10} = (56/2 + 140 + 147 + 156 + 99 + 138 + 100/2)/6 = 126.33$$

نلاحظ أن معامل الاختلاف للسلسلة الخام أكبر من مثيله للسلسلة الصقيلة  $MM3$  وهذا الأخير أكبر من مثيله للسلسلة  $MM6$  وهذا يوضح آلية الصقل التي تمحو البروزات والانخفاضات في مسار السلسلة (الفقرة ٢).

الشكل البياني رقم (٢) السلسلة الخام والسلسلتان الصقيلتان بواسطة الوسط المتحرك للفترات ٦،٣



### ٣- تحليل السلسلة الزمنية وإجراء التنبؤ:

#### ٣-١- مراحل التنبؤ بالمبيعات:

بينت دراسة الظواهر الاقتصادية منذ زمن طويل وجود أنماط مختلفة لتقلباتها وهذه التقلبات يمكن أن تشتمل على المركبات التالية:

- مركبة الاتجاه العام ونرمز لها بالرمز  $(T_t)$  وهى تمثل تغيراً بطيئاً باتجاه محدد يستمر لفترة طويلة.

- المركبة الحلقية أو الدورية ونرمز لها بالرمز  $(C_t)$  وهى تمثل تغيراً شبه دورى يتخلله مراحل نمو ومراحل انخفاض. من أمثلتها حلقة أو دورة Kitchin ذات الفترة من ٤ إلى ٥ سنوات وهى تظهر فى الوضع الاقتصادى العام. وعادة ما يتم فى معظم الدراسات المتعلقة بالسلاسل الزمنية دمج مركبة الاتجاه العام والمركبة الدورية فى مركبة واحدة.

- المركبة الفصلية ونرمز لها بالرمز  $(S_t)$  وهى تتعلق بتغيرات منتظمة تؤثر فى مدار الأسبوع أو الشهر أو الفصل ... إلخ، وهى تظهر فى المواسم وأشياء الأعياد والمناسبات الاجتماعية.

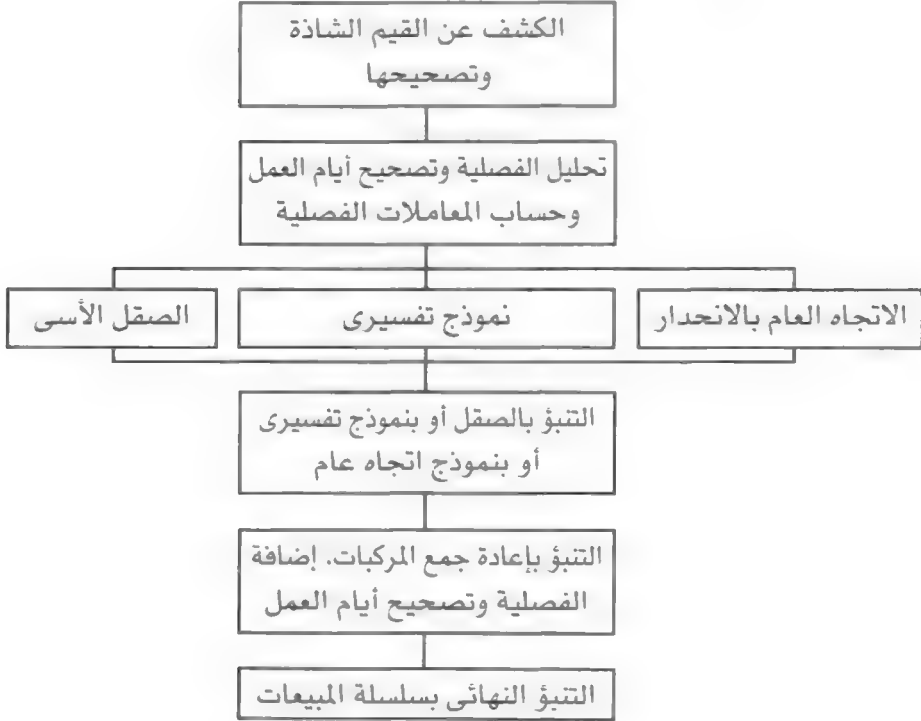
- التقلبات الصدفية (العشوائية) ونرمز لها بالرمز  $(R_t)$  وهى عبارة عن تغيرات عشوائية شديدة الحدوث وتؤدى إلى تقلبات كبيرة أو صغيرة غير ثابتة. وهى تنتج من التأثيرات المحتملة لكل ما يتعلق بالظاهرة المدروسة ولها أشكال متعددة يصعب دراستها بشكل تفصيلى.

يمكن لبعض من المركبات السابقة أن تظهر فى العديد من السلاسل الإحصائية الخام ولكن بعض من هذه الأخيرة تظهر تطوراً زمنياً أكثر تعقيداً. ويمكن تخلص السلسلة من بعض الظواهر كظاهرة النمو العام على سبيل المثال أو من بعض التغيرات الفصلية. ومن الملاحظ أن هذه المركبات المختلفة تتوضع على السلاسل الزمنية الاقتصادية المرتبطة بالوضع الاقتصادى العام وهى غالباً ما تكون سلاسل شهرية أو فصلية. فى حين تكون ذات فترات زمنية مختلفة (أسبوع مثلاً) بالنسبة للسلاسل الخاصة بمجال عمل المنشأة.

يعتبر تفكيك السلسلة الزمنية الممثلة للمبيعات إلى مركباتها الأصلية الهدف من أية طريقة تنبئية وذلك بغية عزل هذه المركبات، ثم إجراء عملية تمديد خارجى لكل واحدة على حدة وبعد ذلك جمع هذه المركبات لتشكيل التنبؤ النهائى المطلوب.

يمثل الرسم التوضيحي رقم (١) المراحل التقليدية المختلفة للتنبؤ بالمبيعات.

الرسم التوضيحي رقم (١): مراحل التنبؤ بالمبيعات



### ٣-٢- البحث عن القيم الشاذة وتصحيحها:

قبل البدء بأية معالجة إحصائية للسلسلة الزمنية للمبيعات، يكون مناسباً التمييز بين:

- حوادث منتظمة وعادية معروفة من قبل ذوى التجربة وتسمى بالحوادث الطبيعية.
- حوادث عرضية، لا يمكن التنبؤ بها، تسمى بالظواهر غير الطبيعية أو الشاذة.

وتظهر كميات الاستهلاك غير الطبيعية فى السلع ذات الاستهلاك الكبير وفى القطاعات الأخرى، ويمكن لهذه الطلبات الكبيرة الاستثنائية الناجمة بسبب التصدير أو بسبب المشتريات الكبيرة أو أيضاً بسبب بعض حوادث التوزيع العرضية (كإضرابات النقل على سبيل المثال) أن تخل أو تشوش بشكل كبير السلسلة الزمنية للمبيعات.

هذه القيم الشاذة ليست إلا نتيجة ظاهرة غير مكررة ذات خاصية استثنائية فالمبيعات الناتجة عن عمليات الترويج التسويقي لا تعتبر ظاهرة شاذة؛ لأنها تشكل جزءاً من الحياة العادية للمنشأة.

إذن للمشكلة وجهان، أولهما يجب التعريف بالمشاهدة الشاذة والآخر يجب تصحيح تلك المشاهدة كي يتم عزل تأثيرها.

### ٣-٢-١- الكشف عن القيم الشاذة:

هناك عدة وسائل للكشف عن القيم الشاذة لكن أى منها لا تعطى نتائج مرضية تماماً. نعرض فيما يلي أربع طرائق ويمكن للقارئ المهتم بالتفاصيل الرياضية لهذه الطرائق العودة إلى المرجع المشار إليه<sup>(١)</sup>.

#### - طريقة مجال الثقة:

تفترض هذه الطريقة التوزيع الطبيعي للملاحظات<sup>(٢)</sup> وتتميز ببساطة تطبيقها. فهي تستلزم فقط حساب الانحراف المعياري لسلسلة المبيعات، ثم عزل جميع المشاهدات الخارجة من مجال الثقة المحدد.

فإذا كانت  $\sigma_x$  تمثل الانحراف المعياري للسلسلة، فيمكننا حساب مجال الثقة بالطريقة التالية:

$$IC = \bar{x} \pm 1.96 \times \sigma_x$$

حيث (١.٩٦) هي القيمة الجدولية للتوزيع الطبيعي عند مستوى دلالة (٥٪).

وكل قيمة تخرج عن المجال المشار إليه سابقاً تعتبر قيمة شاذة.

هناك بعض المشاكل الناجمة عن هذه الطريقة خاصة عند تطبيقها على السلاسل الزمنية ذات الحركة الفصلية الواضحة والشديدة، حيث يكون هناك خطر في إخراج بعض القيم الشهرية الأقل قوة أو الضعيفة من مجال الثقة وإعطاء انطباع بأنها قيم شاذة.

بالعودة إلى المعطيات المعروضة في الجدول ١، يكون مجال الثقة معطى على الشكل التالي:

$$IC = 125.62 \pm 1.96 \times 44.11 \Rightarrow IC = [39.14; 212.05]$$

(١) Vallin ١٩٨٤.

(٢) تعنى فرضية التوزيع الطبيعي للملاحظات أن هناك تماثلاً في التوزيع للقيم حول القيمة المتوسطة.

يلاحظ أن المشاهدة للفترة  $t = 14$  ( $x_{14} = 251$ ) تقع خارج المجال المذكور ومن ثم يمكن الشك فيها باعتبارها قيمة شاذة.

- طريقة اختبار المتوسط:

تفترض هذه الطريقة أيضاً التوزيع الطبيعي للملاحظات ولاختبار تجانس المشاهدة  $x_t$  مع باقى الملاحظات، نطبق اختباراً لمقارنة المتوسطات بين عينتين:

- عينة مخفضة إلى عنصر واحد فقط وهو المشاهدة  $x_t$  وهى عينة نرغب فى اختبار ما إذا كانت شاذة أم لا.

- عينة مكونة من  $(n - 1)$  عنصراً من عناصر السلسلة الزمنية (حيث  $n$  تمثل عدد مشاهدات السلسلة المدروسة).

نحسب الاختبار التالى (المسمى اختبار ستيودنت التجريبي):

$$t_{cal} = \frac{|x_t - \bar{x}|}{\sqrt{\frac{\sum_{j \neq t} (x_j - \bar{x})^2}{(n-1)(n-2)}}$$

إذا تحقق  $t_{cal} > t_{lu}$  (حيث  $t_{lu}$  تمثل القيمة المقروءة من جدول توزيع ستيودنت من أجل  $(n - 2)$  درجة حرية ومستوى دلالة ٥٪)، فإن المشاهدة ( $x_t$ ) تعتبر قيمة شاذة وفى الحالة المعاكسة ( $t_{cal} < t_{lu}$ ) فإن القيمة المدروسة تعتبر قيمة طبيعية.

بإعادة أخذ معطيات الجدول (١) وبتطبيق العلاقة السابقة على المشاهدة ( $t = 14$ ) نحصل على العناصر التالية:

$$\bar{x} = 119 \text{ (بدون المشاهدة } x_{14})$$

$$\sum_{j \neq t} (x_j - \bar{x})^2 = 22362; \quad t_{cal} = \frac{132}{\sqrt{\frac{22362}{19 \times 18}}} = 16.32$$

نلاحظ أن  $t_{cal} = 16.32 > t_{lu} = 2.101$  ( $\alpha$  تساوى ٥٪ وعدد درجات الحرية يساوى  $20 - 2 = 18$ ).

نتائج هذا الاختبار تتوافق مع الاختبار السابق من ناحية اعتبار المشاهدة (١٤) شاذة.

## - طريقة مجال الثقة المضاعف:

تعتبر هذه الطريقة استكمالاً للطريقة الأولى وتناسب بشكل خاص السلاسل الزمنية ذات الحركة الفصلية الواضحة. وتقضى بحساب مجال للثقة لكل عام ولكل شهر (أو فصل). وأية مشاهدة تخرج من كلا المجالين تعتبر قيمة شاذة. يوضح الجدول ٢ هذه الطريقة.

تمثل IC<sub>1</sub> و IC<sub>2</sub> في الجدول المذكور حدود مجالي الثقة وكل مشاهدة يتم مقارنتها مع مجال الثقة السنوي ومجال الثقة الفصلي الذي تنتمي له، وإذا كانت خارج كلا المجالين فإنه يمكن اعتبارها مرشحة لأن تكون قيمة شاذة.

الجدول رقم (٢) حساب مجال الثقة المضاعف (الملف على الإنترنت: C2EX2.XLS)

السنة	فصل ١	فصل ٢	فصل ٣	فصل ٤	المتوسط	الانحراف المعياري	IC <sub>1</sub>	IC <sub>2</sub>
السنة ١	١٦٤	١٩٨	٨٥	١٧٩	١٥٦.٥	٤٣.٠٠	٧٢.٢١	٢٤٠.٧٩
السنة ٢	١٦٨	٢٠١	٩٨	١٩٧	١٦٦	٤١.٢٧	٨٥.١٠	٢٤٦.٩٠
السنة ٣	١٩٧	٢٠٩	١٠٠	٢١٦	١٨٠.٥	٤٦.٩٧	٨٨.٤٤	٢٧٢.٥٦
السنة ٤	٢٢٣	٢٤٥	١١٩	٢٦٠	٢١١.٧٥	٥٥.١٤	١٠٣.٦٧	٣١٩.٨٣
السنة ٥	٢٩٨	٣٠٩	١٢٤	٢٦٧	٢٤٩.٥	٧٤.٠٨	١٠٤.٣١	٣٩٤.٦٩
المتوسط	٢١٠	٢٣٢.٤	١٠٥.٢	٢٢٣.٨	-	-	-	-
الانحراف المعياري	٤٨.٩١	٤١.٨٢	١٤.٣٦	٣٤.٥٣	-	-	-	-
IC <sub>1</sub>	١١٤.١٣	١٥٠.٤٤	٧٧.٠٦	١٥٦.١١	-	-	-	-
IC <sub>2</sub>	٣٠٥.٨٧	٣١٤.٣٦	١٣٣.٣٤	٢٩١.٤٩	-	-	-	-

نقارن على سبيل المثال قيمة الفصل الثاني من السنة الثالثة بقيمة مجال الثقة لفصلها أي [150.44; 314.63] ولسننها أي [88.44; 272.56] ونلاحظ أن تلك القيمة تنتمي لكلا مجالي الثقة ومن ثم تعتبر قيمة طبيعية.

تعطى هذه الطريقة نتائج جيدة كلما ازداد عدد المشاهدات، ومن ثم يمكن أن تكون مناسبة للسلاسل الزمنية الشهرية.

نلاحظ أن الطرائق الثلاثة السابقة تفترض التوزيع الطبيعى للمشاهدات ولكن السلاسل الزمنية الممثلة للمبيعات نادراً ما تخضع مفرداتها للتوزيع الطبيعى الذى يفترض تماثلاً فى التوزيع للمشاهدات مقارنة مع المتوسط ولكن على الرقم من تلك السلبية تبقى هذه الطرائق الأكثر استخداماً لسهولة استخدامها.

#### - الكشف عن القيم الشاذة بواسطة الانحدار:

تقضى هذه الطريقة بإنشاء متغير صامت<sup>(١)</sup> يتعلق بالمشاهدة المراد اختبارها. وهذا المتغير يتكون من القيمة (٠) لكل المشاهدات ما عدا القيمة المشكوك فيها. حيث يأخذ من أجلها القيمة (١). نجرى تقديراً للانحدار وننظر إلى قيمة معلمة الانحدار للمشاهدة المختبرة، فإذا كانت قيمة تلك المعلمة مختلفة معنوياً عن القيمة صفر فذلك يعنى أن القيمة المختبرة هي قيمة شاذة.

تتميز هذه الطريقة بفعاليتها الدقيقة فى اختبار القيم الشاذة وهى لا تفترض أى شرط يتعلق بتوزيع المشاهدات، لكنها تبقى صعبة التطبيق فى حالة البيانات المؤتمتة التى تشتمل على عدد كبير من سلاسل المبيعات.

#### ٢-٢-٣- تصحيح القيم الشاذة:

بعد الكشف عن القيم الشاذة يتم عزل تأثيرها عن باقى قيم السلسلة من خلال استبدالها بقيم أخرى جديدة وسنشرح الآن الوسائل المختلفة التى تسمح بتحديد هذه القيم الجديدة.

#### - التدخل البشرى:

الطريقة الأكثر بساطة والأكثر منطقية لاستبدال القيم الشاذة هي إعطاء مسؤولية هذا الاستبدال إلى إدارى النظام الذى يمتلك من الخبرة ما يكفى لاستبدال تلك القيم. فهو يعلم أسباب الانحراف عن الحدود الطبيعية ويعلم مقدار الاختلاف عن القيم الطبيعية الذى تسببه القيم الشاذة. ولكن فى حالة وجود العديد من الأسباب التى أدت إلى الانحراف فإن ذلك الإدارى قد يصبح عاجزاً عن إجراء التصحيح.

(١) سنعود إلى التعريف بهذه التقنية التى تفترض معرفة نموذج الانحدار المتعدد وتفسيره فى الفصلين الرابع والسادس.



## - مجال الثقة:

فى هذه الحالة فإننا نلجأ إلى إعادة المشاهدة الشاذة إلى أحد حدى مجال الثقة الأعلى أو الأقل. وهذه الطريقة تتميز بسهولة استخدامها وآلية برمجتها ولكنها لا تعنى تحييداً تاماً لأثر تلك القيم حيث تمثل الحدود الطرفية لمجال الثقة حداً نظرياً ليس له أى وجود ويمكن أن يتقلب قليلاً نتيجة عملية الحساب للمعاملات الفصلية.

## - تقدير القيم بواسطة التنبؤ:

تقضى هذه الطريقة باستبدال القيمة غير الطبيعية فى الزمن  $t$  بالقيمة المتوقعة فى الزمن  $T-1$  وذلك بواسطة نموذج التنبؤ للفترة نفسها. وهذا يستلزم إجراء محاكاة للتنبؤ وليس استبدال المشاهدة التى تم الكشف عنها بقيمتها المصححة؛ وذلك لأن هذه الأخيرة تشتمل على جزء من المعلومات المشوهة.

تكمن الفائدة من هذه الطريقة فى عملية العزل التام للمشاهدة الشاذة من خلال توافقها مع النموذج المعد للتنبؤ ولكنها صعبة التطبيق آلياً.

## ٣-٣- مخطط تفكيك السلسلة الزمنية:

تستند آلية تفكيك السلسلة الزمنية إلى مكوناتها الأساسية على نمط النموذج المكون لتلك المركبات. هناك ثلاثة أنماط ممكنة لتكوين مركبات السلسلة الزمنية:

- النمط التجميعى الذى يفترض الاستقلالية بين جميع المكونات ويعبر عنه على الشكل التالى:

$$x_t = T_t + S_t + R_t$$

فى هذه الحالة تكون المركبة الفصلية شديدة فى اتساعها وفى فترتها.

- النمط التضاربى ويأخذ الصيغة التالية:

$$x_t = T_t \times S_t + R_t$$

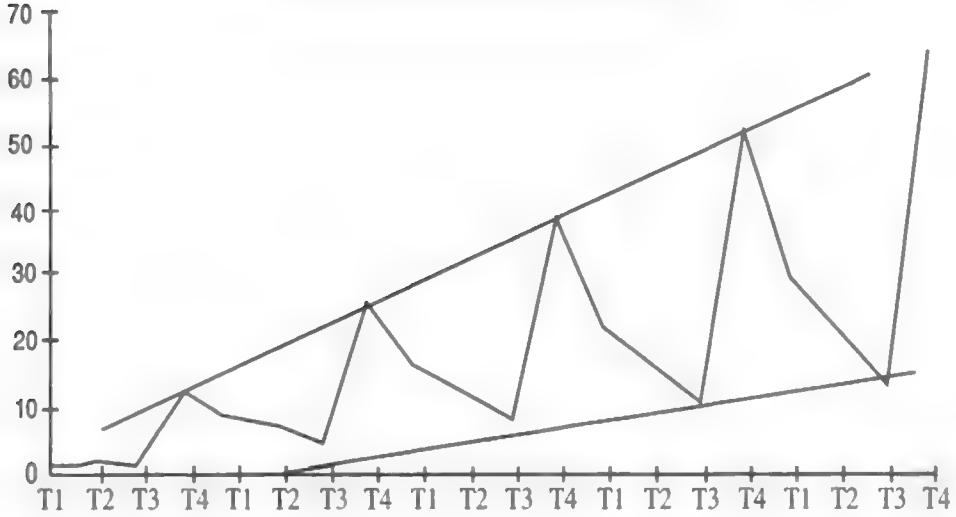
وفى هذا الشكل تكون المركبة الفصلية مرتبطة بمركبة الاتجاه العام (فصلية مرنة مع تغيرات فى السعة بمرور الزمن).

- النمط التضاربى التام ويأخذ الشكل التالى:

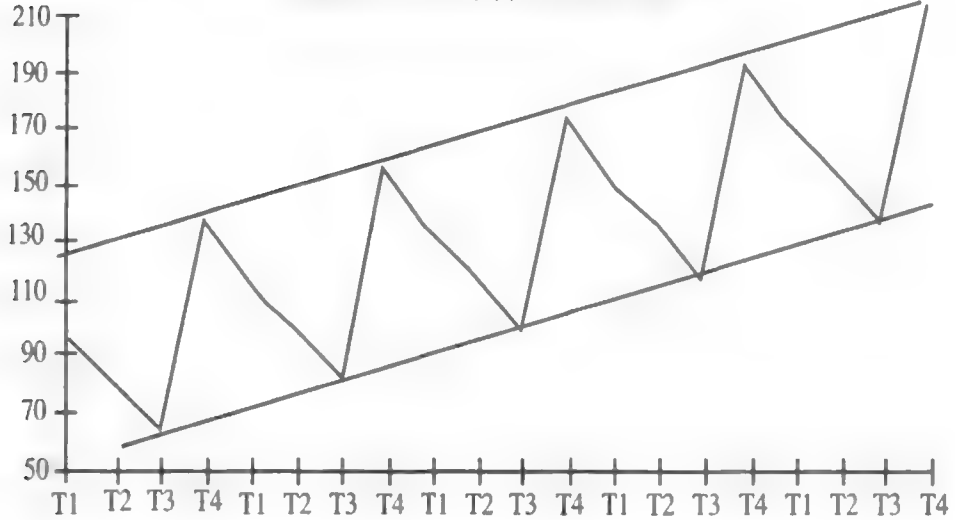
$$x_t = T_t \times S_t + R_t$$

يكون في هذا الشكل تقاطع بين المركبات الثلاث، ويعتبر الأكثر استخداماً في التطبيقات الاقتصادية وهو سهل الاستخدام؛ لأن لو غاريتم هذا الشكل يقود إلى النمط التجميعي.

الشكل البياني رقم (٣) مثال لنمط تجميعي



الشكل البياني رقم (٤) مثال لنمط تضاربي



يتوافق النمط التجميعي (الرسم البياني ٢) مع مسار السلسلة الزمنية التي تستمر فيها المركبة الفصلية بالشكل نفسه دون تعديل مع مرور الزمن وتكون حركة الاتجاه العام قليلة الوضوح.

فى حين أنه فى النمط التضاربي (الرسم البياني ٤) يكون هناك اعتبار لسعة المركبة الفصلية فى تحركها مع الزمن وبشكل نسبى مع قيمة مركبة الاتجاه العام. وفى هذا النمط يمكن العودة إلى النمط التجميعى من خلال أخذ اللوغاريتم. أى:

$$(Log(ab) = Log a + Log b)$$

$$Log(x_t) = Log(T_t \times S_t \times C_t \times R_t) = LogT_t + LogC_t + LogR_t$$

سنشرح فى الصفحات القادمة هذه المركبات الأربعة بشكل متتالٍ، وسيكون تركيزنا بشكل أكبر على مركبتى حركة الاتجاه العام والمركبة الفصلية.

### ٣-٤- مركبة الاتجاه العام La tendance:

عند النظر إلى التمثيل البياني لأية سلسلة زمنية، فإننا نلاحظ بسهولة وجود حركة للاتجاه العام لمسار تلك السلسلة، وهدفنا فى هذه الفقرة هو شرح طرائق حساب بسيطة تسمح بمعرفة حركة الاتجاه العام على المدى المتوسط بأكبر قدر ممكن من الدقة. هناك مجموعة مختلفة من الطرائق الأولية لتقدير مركبة الاتجاه العام فعلى سبيل المثال نستطيع من خلال إجراء النسبة بين قيمتين طرفيتين حساب النسبة المثوية الإجمالية للزيادة فى السلسلة المدروسة ومن ثم تحديد معدل تزايد شهري متوسط ومعرفة المسار العام لاتجاه السلسلة. ولكن عملية انتقاء القيم المتطرفة هى عملية اختيارية ويمكن لأية مشاهدات أخرى أن تكون منتقاة. بالإضافة إلى ذلك، فنحن لا نأخذ بعين الاعتبار باقى قيم السلسلة واكتفينا فقط بقيمتين.

لإجراء تقدير أفضل لمركبة الاتجاه العام يكون ضرورياً الاستعانة بمفاهيم الإحصاء الرياضى التي تعطى بعض الأدوات اللازمة للحساب.

#### - الاتجاه العام بواسطة الوسط المتحرك:

تم فى الفقرة السابقة التعرف على مفهوم الوسط المتحرك وآلية عمله فى صقل المنحنيات المثلّة للسلاسل الزمنية. ومن خلال أخذ درجة مرتفعة للوسط المتحرك يمكننا تخفيض التقلبات الحاصلة فى مسار السلسلة (كلما زادت درجة الوسط المتحرك: أدى ذلك إلى حذف التقلبات فى المنحنى المصقول).

هناك سلبيتان تتعلقان باستخدام الأوساط المتحركة بوصفها أداة لتحديد حركة الاتجاه العام، الأولى تتمثل فى تقليص عدد مفردات السلسلة المدروسة، فمركبة الاتجاه العام لا يمكن الحصول عليها إلا من أجل الفترة الزمنية الممتدة من المشاهدة  $(m+1)$  إلى المشاهدة  $(n-m)$ . والسلبية الثانية تكمن فى عدم وجود أى مبدأ معقول للتمديد الخارجى لمركبة الاتجاه العام المحددة بواسطة الوسط المتحرك، فإذا رغبتنا فى إجراء إسقاطات للسلسلة المصقولة فإننا بحاجة لإدخال نموذج أكثر تفسيراً لتمثيل مركبة الاتجاه العام.

وهكذا فإن المتوسطات المتحركة تستخدم لأهداف وصفية بحتة للسلاسل الزمنية الاقتصادية، أو لحذف مركبة الاتجاه العام بغية دراسة خاصية ما من خصائص المركبة العشوائية مثل دراسة دورات النشاط الاقتصادى.

#### - الاتجاه العام بواسطة الانحدار:

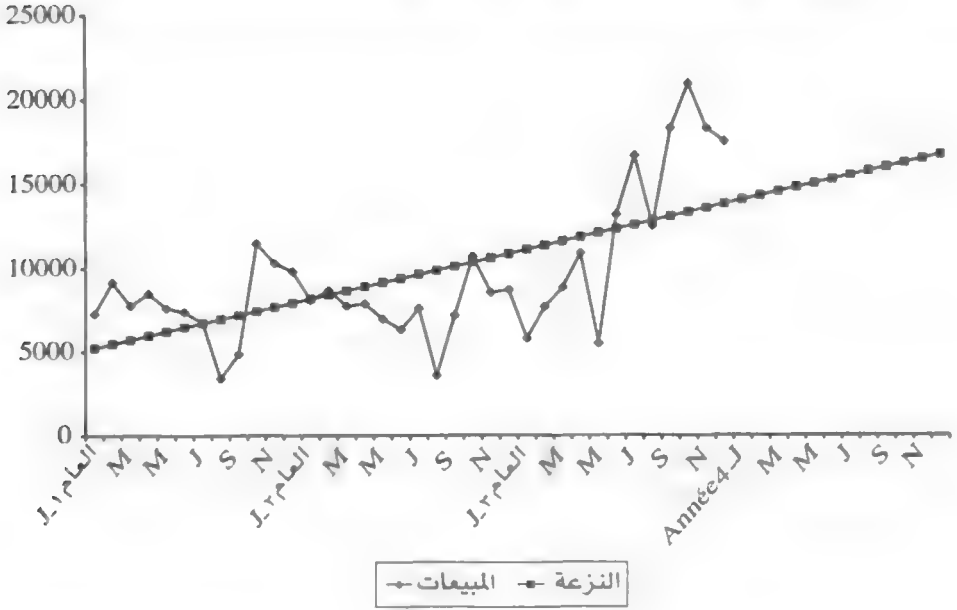
فى هذه الحالة نعمل على تقدير مركبة الاتجاه العام بواسطة كثير حدود من الشكل:

$$x_t = \alpha_0 + \alpha_1 t + \alpha_2 t^2 + \alpha_3 t^3 \dots$$

لنأخذ على سبيل المثال كثير حدود من الدرجة الأولى:  $x_t = \alpha_0 + \alpha_1 t$ ، الذى يفترض أن مركبة الاتجاه العام خطية (الشكل البيانى ٥) ويمكن تمثيلها بواسطة خط مستقيم يتوافق مع توفيق طريقة المربعات الصغرى.

يتلخص الهدف هنا فى تقدير مركبة الاتجاه العام على المدى الطويل للسلسلة المدروسة بواسطة مستقيم (أو كثير حدود من درجة أعلى) مُقدر بواسطة طريقة المربعات الصغرى العادية (MCO). وهذه الطريقة تعطى بالإضافة إلى تقديرات المعالم  $\alpha_1$  و  $\alpha_0$  أى  $\hat{\alpha}_1$  و  $\hat{\alpha}_0$  الانحرافات المعيارية للمعاملات، ومن ثم تسمح بإجراء اختبارات إحصائية (اختبارات المعالم فى الفصل الثالث). تفترض هذه الطريقة ثبات المعالم  $\alpha_1$  و  $\alpha_0$  مع الزمن، وتسمى طريقة التنبؤ باستخدام هذه التقنية «التمديد الخارجى للسلسلة». وتبقى هذه الطريقة مفيدة لتقدير حركات الاتجاه العام الشديدة للظواهر الاقتصادية.

الشكل البياني رقم (٥) مثال لتقدير مركبة الاتجاه العام بواسطة خط مستقيم



تُعطى قيم المعاملات المقدرة لكثير الحدود من الدرجة الأولى بواسطة العلاقات التالية، وذلك باستخدام طريقة المربعات الصغرى العادية:

$$\hat{a}_1 = \frac{\sum_{t=1}^{t=n} (x_t - \bar{x})(t - \bar{t})}{\sum_{t=1}^{t=n} (t - \bar{t})^2}$$

$$\hat{a}_0 = \bar{x} - \hat{a}_1 \bar{t}$$

حيث تمثل  $n$  عدد المشاهدات.

ويعطى التنبؤ المحسوب في اللحظة  $n$  (عند آخر مشاهدة) للمجال  $h$  بالعلاقة التالية:

$$x_{n+h} = \hat{a}_1 (n + h) + \hat{a}_0$$

حيث تمثل  $h$  مجال التنبؤ.

نستطيع من خلال البرمجيات الإحصائية الحصول على القيم المقدرة للمستقيم الممثل لحركة الاتجاه العام. ويمكن العودة للملف C2EX2 للحصول على مثال تطبيقي. ومن أجل هذا المثال نحصل على المستقيم المقدر التالى:

$$T_t = 243.39 t + 4986.32$$

وباعتبار القيمة الابتدائية المساوية لـ (٤٩٨٦,٣٢) فإن المبيعات تتزايد وسطياً ضمن تلك الفترة بمقدار (٢٤٣,٣٩) وحدة شهرياً، ومن ثم فإن التنبؤ يقضى بإجراء تمديد خارجى لهذا المستقيم الممثل لحركة الاتجاه العام للسلسلة.

يرتبط اختيار درجة كثير الحدود بعدة معايير منها مجال التنبؤ، الانقطاعات فى حركة الاتجاه العام لحياة المنتج وكذلك عدد المشاهدات المتاحة. ويمكن من خلال البرمجيات الجاهزة (البرنامج إكسل) تقدير أى شكل كان للمعادلة الممثلة لشكل الاتجاه العام.

تتميز هذه الطريقة فى التقدير ببساطتها ومرونة استخدامها ولكن لهذه الطريقة نقطتى ضعف:

- استخدامهما للزمن باعتباره متغيراً تفسيرياً وحيداً.
- ثبات المعاملات المقدرة على طول فترة الدراسة.

### ٣-٥- المركبة الفصلية La saisonnalité:

#### ٣-٥-١- لماذا نحلل الحركة الفصلية؟

تعتبر السلاسل الزمنية ذات التقلبات الموسمية صعبة التفسير ولذلك يتم عادة تخليص هذه السلاسل من المركبة الفصلية حتى تتضح آلية تطورها ومن ثم التنبؤ بمسارها المستقبلى.

وقبل البحث فى طرائق دراسة المركبة الفصلية، يجب فهم السلبيات التى تتجم عن الطريقة المستخدمة عادة فى تحليل الوضع الاقتصادى العام وهى تقضى بإجراء مقارنة للشهر الأخير الملاحظ فى سلسلة البيانات (أو الفصل الأخير، ...) مع الشهر (أو الفصل، ...) الموافق من السنة السابقة أو المقارنة المباشرة لتطور المبيعات من شهر إلى آخر. والهدف من هذه الطريقة هو تحديد الاتجاه الجديد للظاهرة ولكن النتائج قد تكون خاطئة للسببين التالين:

- قد يكون الاتجاه العام المتوسط بين شهر ما (أو فصل ما، ...) والشهر (أو الفصل، ...) الموافق له من العام السابق مختلفاً بشكل ملموس عن الاتجاه الجديد للسلسلة.

- إن المقارنة المستندة إلى مشاهدين اثنتين فقط غالباً ما تكون متأثرة بالأسباب العرضية التي تؤثر في الظاهرة في التواريخ المحددة، ولذلك فإن الحكم الصحيح حول حركة الاتجاه العام لتطور الوضع الاقتصادي يجب أن يستند إلى تحليل كامل لمشاهدات السلسلة الزمنية وليس الاختصار فقط على مشاهدين.

كما أن وجود حركة موسمية في المبيعات من سلعة ما قد يخفي الحركة الحقيقية لمسيرة هذه المبيعات، ومن ثم فإن السلاسل الزمنية الخام للمبيعات التي تحتوى على تأثيرات موسمية لا يمكن تفسيرها. بالمقابل فإنه سيكون أكثر سهولة التنبؤ بالمبيعات دون وجود تقلبات موسمية للأسباب التالية:

- إمكانية حساب المركبة «الحقيقية» لحركة الاتجاه العام.
- كذلك يمكن إيضاح التأثير الحقيقي للعناصر التفسيرية (إعلان، تخفيضات، ...)
- على حركة المبيعات.

### ٣-٥-٢- تصحيح أيام العمل:

قبل البدء بعملية حساب معاملات المركبة الفصلية، يكون ضرورياً إجراء تصحيح لأيام العمل الحقيقية (CJO) كي نكون على يقين بخصوص عدد أيام العمل الحقيقية في الشهر المدروس. فعلى سبيل المثال فإن عدد أيام العمل في شهر آذار أكثر من شهر شباط، ومن ثم يجب علينا التمييز بين هذه الأشهر سواء أكان يتعلق ذلك بالإنتاج (الشديد الارتباط بأيام العمل) أو بمواعيد التسليم (أقل ارتباطاً) أو بالطلبات (قليلة الارتباط بأيام العمل).

فيما يتعلق بالقطاع الصناعي، يكون هذا التأثير محدوداً جداً بسبب التنسيق المسبق الذي تتخذه هذه المنشآت بحيث تعمل على تسليم البضائع للزبائن بالتواريخ المحددة. أما في قطاع السلع ذات الاستهلاك الكبير: فإن تأثير أيام العمل على المبيعات للمستهلكين يكون شديداً بسبب إغلاق المتاجر خارج تلك الأيام.

إن عملية التصحيح لأيام العمل تتم على النحو التالي:

إذا افترضنا أن MJO تمثل العدد المتوسط من أيام العمل الفعلية لشهر ما من السنة (تقريباً ٢١ يوماً)، فإن السلسلة CJO تكون مساوية لـ:

$$(x_t \times NJO) / MJO \times 100$$

حيث:  $x_t$  تمثل المشاهدة للشهر، و  $t$  للسلسلة الخام، و NJO عدد أيام العمل الفعلية للشهر  $t$ .

### ٣-٥-٣ حساب المركبة الفصلية:

ليس هناك من طريقة مثلى لتقدير المعاملات الفصلية، فمهما كانت الطريقة المستخدمة يبقى هناك دائماً خطر إدخال بعض التقلبات العشوائية المسماة أحياناً قيماً شاذة ضمن تقلبات المركبة الفصلية. لذلك فعند حساب المركبة الفصلية لا بد من تحديد بعض الخيارات المتعلقة بنمط المعاملات الفصلية (تجميعي/تضاربي، ثابتة/منزلة) وهي تبعاً لها ستكون المعاملات الفصلية مختلفة بعض الشيء وبشكل عام لا بد من مراعاة بعض القواعد.

#### - مبدأ «الحفاظ على المدى» La conservation des aires:

يجب أن يكون متوسط السلسلة الخام مساوياً لمتوسط السلسلة المصححة من التقلبات الفصلية CVS. فالهدف من تحليل التقلبات الفصلية هو الحصول على توزيع جديد لمسار السلسلة السنوى دون أن يؤدي ذلك إلى تعديل القيم السنوية التراكمية، أى يجب أن تكون المتوسطات السنوية للسلسلة الخام وللسلسلة المصححة متطابقة. يسمى هذا المبدأ مبدأ الحفاظ على المدى.

#### - اختيار نمط تفكيك السلسلة الزمنية:

رأينا سابقاً أنه يوجد نمطان أساسيان لتفكيك السلسلة الزمنية إلى مكوناتها الأساسية:

- النمط التجميعي:  $x_t = T_t + S_t + R_t$  (الفصلية فى هذا النمط شديدة فى الاتساع وفى الفترة).

- النمط التضاربي:  $x_t = T_t \times S_t \times R_t$  (تأثير متبادل للمركبات الثلاثة).

فى حالة النمط التجميعي فإننا نعبر عن المعاملات بالوحدة المستخدمة نفسها لمشاهدات السلسلة الزمنية. ولناخذ على سبيل المثال سلسلة الكميات المسلمة من الفولاذ والمقدرة بآلاف الأطنان وبافتراض أن قيمة معامل شهر آب مساوية لـ (١٢٥) - فإن ذلك يعنى أنه فى شهر آب تنقص الكميات المسلمة من الفولاذ بمقدار (١٢٥) ألف طن. فى هذا النمط من التحليل فإن المعاملات الفصلية لا تأخذ بعين الاعتبار مركبة الاتجاه العام للسلسلة. ولكي يتحقق مبدأ الحفاظ على المدى فإن مجموع المعاملات الفصلية يجب أن يكون مساوياً للصفر.



فى حالة النمط التضاربى، تكون المعاملات الفصلية ممثلة بنسب مئوية (فإذا كان معامل شهر آب يساوى لـ (٠,٨٢) على سبيل المثال، فذلك يعنى نقص الكميات المسلمة فى شهر آب بمقدار (١٨٪). وفى هذا التحليل يتم دمج مركبة الاتجاه العام مع المركبة الفصلية وهذا النمط يمثل الطريقة الأكثر استخداماً.

يجب أن يكون مجموع المعاملات الفصلية مساوياً لعدد العوامل الفصلية (المتوسط يجب أن يساوى الواحد) وفى حالة البيانات الشهرية فإن مجموع المعاملات يساوى (١٢) وللبينات الفصلية يكون المجموع مساوياً (٤) وذلك لاحترام مبدأ الحفاظ على المدى.

إن اختيار طريقة التفكيك يعتمد على مسار السلسلة، فإذا كانت مركبة الاتجاه العام قليلة الوضوح فإن استخدام كلتا الطريقتين يقود إلى نتائج متماثلة تقريباً، أما فى حال بروز مركبة واضحة للاتجاه العام فإننا نستخدم النمط التضاربى. والتأثير السلبى الوحيد لاستخدام المعاملات الفصلية التضاربية يحدث عندما تكون سلسلة المبيعات متأثرة بحركة فصلية قوية وواضحة، وفى بعض الصناعات يمكن أن تكون معدومة لبعض الأشهر فى العام ومن ثم فإن التقسيم أو الضرب بقيم صغيرة جداً يؤدي إلى تضخيم الحركة الفصلية، ويمكن أن يولد سلسلة مصححة من التقلبات الفصلية تشتمل على بعض القيم المتطرفة أو الشاذة.

#### - معاملات ثابتة أم منزلقة ؟ Fixes ou glissants

- المعاملات الثابتة: هى المعاملات التى لا تتغير قيمها المحسوبة من سنة إلى أخرى.

- المعاملات المنزلقة: هى تلك التى تتغير قيمها مع تغير السنوات.

و كما هو معلوم فإن التقلبات الموسمية تتكرر من سنة إلى أخرى بشكل متماثل ومن ثم يكون من غير المفيد اللجوء إلى استخدام المعاملات المختلفة من سنة إلى أخرى. ولكن فى بعض الحالات عندما يوحى تأثير اقتصادى ما بتطور مختلف فى السلوكيات يكون مفيداً إدخال مركبة فصلية منزلقة.

إن حساب المعامل الفصلى الشهري يقود إلى خطر إدخال بعض المكونات العشوائية "bruit" فى المركبة الفصلية، ومن ثم فإن التمييز بين المركبة الفصلية ومركبة البواقي résidu سيكون صعباً فى غياب وجود قيود صارمة حول المعاملات الفصلية. فعلى

سبيل المثال إذا كان الاستهلاك من مادة زراعية ما جيداً فى إحدى السنوات لأسباب مناخية: فإن الفصلية المنزلة ستعكس هذا التأثير الفصلى على العام التالى دون أى سبب موجب ودون معرفتها المسبقة بالظروف المناخية.

هناك خطر آخر يجب الإشارة إليه وهو ما يتعلق بالخلط المحتمل بين الفصلية الحقيقية والفصلية الوهمية المختلفة من قبل المنشأة. فهناك بعض المنشآت تجرى كل عام وفى التاريخ نفسه عمليات ترويج للمبيعات (عبر الدعاية والتخفيضات والإغراءات ... إلخ) أو تغييرات فى التعرفة السعرية، وبحساب المعاملات الفصلية يتم تخصيص المبيعات الزائدة الناجمة عن هذه العمليات إلى المركبة الفصلية على الرغم من أن هذه المبيعات تعود لسياسة إرادية للمنشأة ولا تمثل تأثيراً فصلياً. والمشكلة تظهر عندما تعدل المنشأة تواريخ تلك التخفيضات أو التعديلات السعرية وفى هذه الحالة فإن استخدام المعاملات الفصلية المنزلة يسمح بشكل سريع بإدخال ودمج هذه التعديلات.

#### - طرائق الحساب:

لا يوجد طريقة مرضية تماماً لتقدير المعاملات الفصلية، وكما ذكرنا سابقاً فإن استخدام أية طريقة سيؤدى إلى تفاقم خطر إدخال بعض التقلبات العائدة لقيم عشوائية أو لعادات ترويجية فى المركبة الفصلية.

ولكن فى الحالات التقليدية الأكثر استخداماً يتم حساب المعاملات الفصلية الثابتة وفقاً للنمط التضاربي.

وتختلف قيم المعاملات الفصلية تبعاً للطريقة المستخدمة، وسنعرض فيما يلى طريقتين للحساب للمعطيات نفسها (يتعلق المثال بمبيعات منتج فصلى له علاقة بموسم الأعياد) مبينين وسائل الحساب المتبعة ومراحلها المختلفة.

١- تحليل الفصلية وفقاً للنمط التجميعى باستخدام المعاملات الثابتة (الملف C2EX4):

يبين الجدولان (٣ و ٤) نتائج حساب المعاملات الفصلية وفقاً للنمط التجميعى باستخدام المعاملات الثابتة.

الجدول رقم (٣) تحليل الفصلية: جدول الحساب وفقاً للنمط التجميعي

التاريخ	المبيعات	MM١٢	الانحراف	المبيعات CVS
السنة ١ - ك	٤٠١,٦٠	-	-	٦٠٧,١٧
شباط	٣٩٥,٧٠	-	-	٦٢٨,٨٥
آذار	٤٥١,٠٠	-	-	٦٠٥,٥٨
نيسان	٤٢٧,٦٠	-	-	٥٤٥,٩٢
أيار	٤٩٦,٨٠	-	-	٦٣٧,٨٨
حزيران	٤٦٧,٧٠	-	-	٥٦٠,٩٦
تموز	٣٥٢,٣٠	٥٦٥,٦٠	٢١٣,٣٠-	٤٩٨,٩٦
أب	١٨٢,١٠	٥٥٥,٤٦	٣٧٣,٣٦-	٥٣٥,٩٩
أيلول	٥٢٢,٣٠	٥٤٦,٣٠	٢٤,١٠-	٥٢٩,٧٦
ت١	٦٨٧,٢٠	٥٣٩,٣٢	١٤٧,٨٨	٥٥٢,٤٨
ت٢	١٠٨٠,٣	٥٢٨,٥٨	٥٥١,٧٢	٥٧٩,٠٥
ك١	١٣٩١,٦	٥١٧,٣٠	٨٧٤,٤٠	٥٧٣,٥٠
السنة ٢ - ك	٢٦٣,٩٠	٥١٧,٢١	٢٥٣,٣١-	٤٦٩,٤٧
شباط	٢٨٩,٩٠	٥١٩,٧٥	٢٢٩,٨٥-	٥٢٣,٠٥
آذار	٣٣٧,٠٠	٥١٩,٤٠	١٨٢,٤٠-	٤٩١,٥٨
نيسان	٣٧٤,٠٠	٥١٧,٥٣	١٤٣,٥٣-	٤٩٢,٣٢
أيار	٢٩٢,٧٠	٥١١,٦٦	٢١٨,٩٦-	٤٣٣,٧٨
حزيران	٣٩٨,٦٠	٥٠٤,١٦	١٠٥,٥٦-	٤٩١,٨٦
تموز	٤٢١,٧٠	٥٠٦,٠٥	٨٤,٣٥-	٥٦٨,٣٦
أب	١٧٣,٨٠	٥١٢,٥٥	٣٣٨,٧٥-	٥٢٧,٦٩

تابع - الجدول رقم (٣).

التاريخ	المبيعات	MM١٢	الانحراف	المبيعات CVS
أيلول	٥٢٢,١٠	٥١٧,٤٦	٤,٦٤	٥٢٩,٦٦
ت ١	٦٤٢,٤٠	٥٢٥,١٧	١١٧,٢٢	٥٠٧,٦٨
ت ٢	٩٨٤,٢٠	٥٣٧,٧٥	٤٤٦,٤٥	٤٨٢,٩٥
ك ١	١٣٠٧,٦	٥٥٠,١٣	٧٥٧,٤٧	٤٨٩,٥٠
السنة ٢-٣-ك	٣٩٣,٤٠	٥٥٥,٥٧	١٦٢,١٧-	٥٩٨,٩٧
شباط	٣١٦,٢٠	٥٥٦,٩٧	٢٤٠,٧٧-	٥٤٩,٣٥
آذار	٤٢٨,٦٠	٥٥٩,٦٨	١٣١,٠٨-	٥٨٣,١٨
نيسان	٤٦٧,٦٠	٥٦٥,٠٥	٩٧,٤٥-	٥٨٥,٩٢
أيار	٥٠١,٠٠	٥٦٨,٥٢	٦٧,٥٢-	٦٤٢,٠٨
حزيران	٤٨٧,٤٠	٥٧٢,٧٠	٨٥,٣٠-	٥٨٠,٦٦
تموز	٤٦٣,٣٠	-	-	٦٠٩,٩٦
آب	١٦٥,٩٠	-	-	٥١٩,٧٩
أيلول	٥٩٥,١٠	-	-	٦٠٢,٦٦
ت ١	٦٩٨,١٠	-	-	٥٦٣,٣٨
ت ٢	١٠١٢,٠٠	-	-	٥١٠,٧٥
ك ١	١٣٨٠,٠٠	-	-	٥٦١,٩٠
المتوسط	٥٤٩,٢٤			٥٤٩,٢٤
الانحراف المعياري	٣٢٥			٥٠,٨٣
معامل الاختلاف	٠,٥٩			٠,٠٩

ومن خلال الجدول (٣) نستوضح مراحل الحساب المختلفة:

المرحلة ١: تقدير مركبة الاتجاه العام بواسطة وسط متحرك<sup>(١)</sup> من الدرجة ١٢ (العمود MM١٢).

فمن خلال تطبيق العلاقة المعروضة فى الفقرة ٢-٢ نحصل على قيم العمود السابق، ولكننا لا نستطيع حساب هذه القيم للمفردات الستة الأولى (من كانون الثانى إلى حزيران من السنة الأولى) وكذلك القيم فى نهاية السلسلة (من تموز إلى كانون الأول من السنة ٢). فى هذه الحالة لم يعد فى العمود المسمى MM١٢ وجود لمركبة فصلية.

لنأخذ مثلاً يبين طريقة الحساب لهذا العمود ولتكن قيمة شهر كانون الثانى من العام ٢:

$$MM12_{J,2} = (0.5 \times 352.30 + 182.10 + 522.20 + \dots + 398.6 + 0.5 + 421.7)/12 = 517.20$$

المرحلة ٢: حساب الانحرافات عن السلسلة المشاهدة.

نحسب الانحرافات المشاهدة بين السلسلة الخام والوسط المتحرك:

$$e_t = x_t - MM12_t$$

مثال للحساب لشهر كانون الثانى من السنة ٢:

$$e_{J,2} = 263.9 - 517.21 = -253.31$$

المرحلة ٣: تجميع الانحرافات المتعلقة فى الشهر نفسه للسنوات المختلفة وحساب المتوسط.

فى الجدول (٤)، نحسب فى العمود الأول المعاملات الفصلية المؤقتة من خلال تجميع الانحرافات المتعلقة بالشهر نفسه وحساب المتوسط لهذه الانحرافات. وهذه الأرقام تمثل المعاملات الفصلية المؤقتة وذلك لأن مجموعها لا يساوى الصفر.

$$e_{13}, e_{25} \Rightarrow S_1^P = (-253.31 - 162.17)/2 = -207.47 \text{ الشهر الأول:}$$

$$e_{14}, e_{26} \Rightarrow S_2^P = (-229.85 - 240.77)/2 = -235.31 \text{ الشهر الثانى:}$$

...

$$e_{12}, e_{24} \Rightarrow S_{12}^P = (575.47 + 874.40)/2 = 815.94 \text{ الشهر الثانى عشر:}$$

(١) يمكننا أن نحسب أيضاً مركبة الاتجاه العام بواسطة مستقيم الانحدار.

الجدول رقم (٤) تحليل الفصلية: معاملات فصلية مؤقتة ومعاملات نهائية

العمليات	المؤقتة $S_p$	النهائية
S١	$207.74 = 2 / (162.17 - 253.21)$	$200.07 -$
S٢	$235.31 = 2 / (240.77 - 229.80 -)$	$232.10 -$
S٣	$106.74 = 2 / (121.08 - 182.40 -)$	$104.08 -$
S٤	$120.49 = 2 / (97.40 - 142.02 -)$	$118.22 -$
S٥	$143.24 = 2 / (67.02 - 218.96 -)$	$141.08 -$
S٦	$90.42 = 2 / (80.30 - 100.06 -)$	$92.26 -$
S٧	$148.82 = 2 / (84.20 - 212.30 -)$	$146.66 -$
S٨	$206.00 = 2 / (228.70 - 272.26)$	$202.89 -$
S٩	$9.72 = 2 / (4.64 + 24.10 -)$	$7.06 -$
S١٠	$122.00 = 2 / (117.22 + 147.88)$	$124.72$
S١١	$499.08 = 2 / (446.40 + 551.72)$	$501.20$
S١٢	$810.94 = 2 / (704.47 + 874.40)$	$818.10$
المجموع	$20.99 -$	$0$
المتوسط	$2.17 -$	$0$

المرحلة ٤: حساب  $S = S_1^P + S_2^P + \dots + S_{12}^P$

وبعد ذلك يتم معايرة المعاملات الفصلية بحيث يصبح مجموعها مساوياً للصفر.

فإذا كانت  $S = 0$ ، فإننا نعتبر المعاملات  $S_1^P, S_2^P, \dots, S_{12}^P$  معاملات فصلية نهائية.

أما إذا كانت  $S \neq 0$ ، فإننا نعرف المعاملات النهائية على النحو التالي:

$$S_1 = S_1^P - S/12; S_2 = S_2^P - S/12; \dots; S_{12} = S_{12}^P - S/12$$

مثال:  $S = -25.99$  ومن ثم تكون  $S_2 = -235.31 - (-25.99/12) = -233.15$

المرحلة ٥: حساب السلسلة CVS:

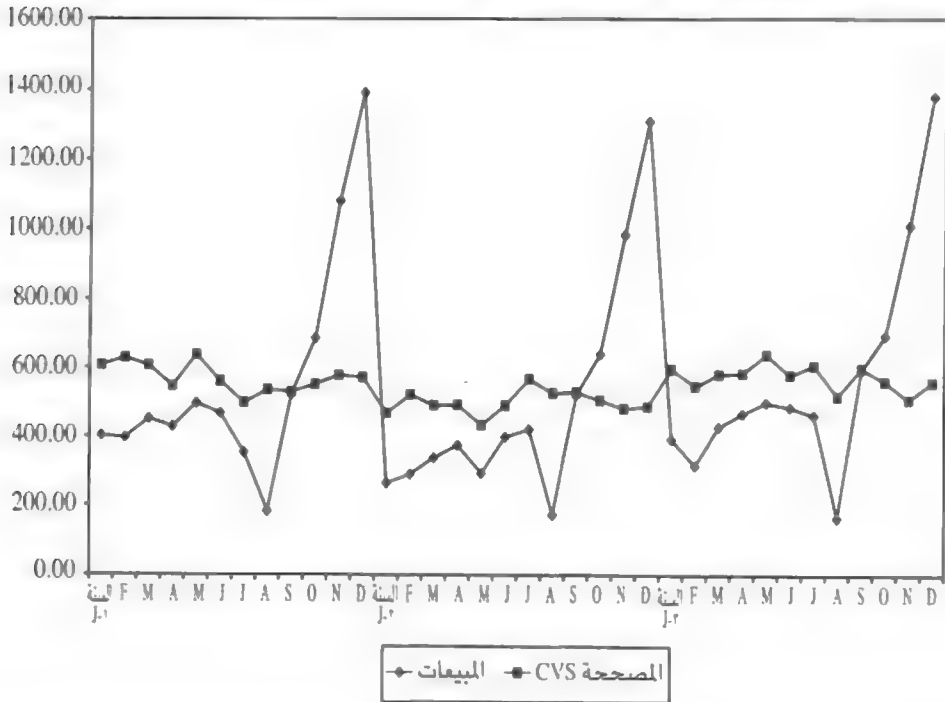
يتم حساب السلسلة المصححة من التقلبات الفصلية CVS بعملية تفاضل بين السلسلة الخام والمعامل الفصلي للشهر المعتبر.

فمن أجل شهر كانون الثاني من العام الثاني تكون المبيعات المصححة من التقلبات الفصلية مساوية لـ:

$$263.90 - (-205.57) = 607.17$$

نعرض في الشكل البياني رقم (٦) السلسلة الخام والسلسلة المصححة من التقلبات الفصلية (CVS).

الشكل البياني رقم (٦) تحليل الفصلية: معاملات فصلية ثابتة ونمط تجميعي



نلاحظ من الشكل البياني أن عملية نزع المركبة الفصلية خفضت بشكل كبير تباين السلسلة (هذا يلاحظ من خلال انخفاض معامل الاختلاف في الجدول ٢) وأن المبيعات دون المركبة الفصلية تبدو كأنها ثابتة ومن ثم من السهل التنبؤ بحركتها المستقبلية.

ب- تحليل الفصلية وفقاً للنمط التضاربي وباستخدام المعاملات المنزلة (الملف C2EX3):

نعرض في الجدول (٥) نتائج حساب المعاملات الفصلية للسلسلة السابقة نفسها. ولكن باستخدام النمط التضاربي والمعاملات المنزلة.

مراحل الحساب المتبعة هي التالية:

المرحلة ١: تقدير مركبة الاتجاه العام بواسطة الوسط المتحرك. وهذه المرحلة مماثلة للمرحلة الأولى من الحالة السابقة.

المرحلة ٢: حساب النسبة بين السلسلة المشاهدة والوسط المتحرك.

في حالة النمط التضاربي نحسب النسبة بين السلسلة الخام والوسط المتحرك:

$$S_t^P - x_t / (MM12_t)$$

فيما يتعلق بالأشهر الستة الأولى والأخيرة فإنه لا يمكن حساب الأوساط المتحركة من الدرجة ١٢. ولإتمام هذا العمود: فإننا نكمل القيمة للشهر نفسه من العام التالي للأشهر الستة الأولى والقيمة للشهر نفسه من العام السابق للأشهر الستة الأخيرة.

المرحلة ٣: جعل المعاملات معيارية (المحافظة على المدى).

نجعل المعاملات الفصلية معيارية بحيث يصبح متوسطها لعام ما مساوياً للواحد الصحيح. نعاير المعاملات الفصلية سنة بسنة بحيث يكون مجموعها يساوي ١٢.

$$\text{نحسب } S = S_1^P + S_2^P + \dots + S_{12}^P \text{ ومن ثم}$$

$$S_1 = (S_1^P \times 12/S), S_2 = (S_2^P \times 12/S), \dots, S_{12} = (S_{12}^P \times 12/S)$$

المرحلة ٤: حساب السلسلة المصححة من التقلبات الفصلية CVS.

يتم حساب السلسلة CVS بأخذ النسبة بين السلسلة الخام والمعامل الفصلية للشهر المعتبر.



مثال للحساب لشهر شباط من العام ٢: نحسب مجموع الـ ١٢ معامل فصلي مؤقت من كانون الثاني إلى كانون الأول من العام ٢، أي:

$$S = 0.51 + 0.56 + 0.65 + \dots + 2.38 = 11.41$$

$$S_{\text{fev-2}} = (0.56 \times 12) / 11.41 = 0.59$$

وتكون قيمة المبيعات CVS لشهر شباط من العام ٢ مساوية لـ:  $289.90 / 0.59 = 494.37$ .

الجدول رقم (٥) حساب المعاملات الفصلية المنزلة باستخدام النمط التضاربي

التاريخ	المبيعات	MM١٢	النسبة	المعيار	المبيعات CVS
السنة ١-ك	٤٠١,٦٠	-	٠,٥١	٠,٥٢	٧٦٨,٥٥
شباط	٣٩٥,٧٠	-	٠,٥٦	٠,٥٧	٦٩٢,٧٣
آذار	٤٥١,٠٠	-	٠,٦٥	٠,٦٦	٦٧٨,٧٤
نيسان	٤٢٧,٦٠	-	٠,٧٢	٠,٧٤	٥٧٧,٧٧
أيار	٤٩٦,٨٠	-	٠,٥٧	٠,٥٩	٨٤٧,٩٩
حزيران	٤٦٧,٧٠	-	٠,٧٩	٠,٨١	٥٧٧,٦٣
تموز	٣٥٢,٣٠	٥٦٥,٦٠	٠,٦٢	٠,٦٤	٥٥٢,٣٨
آب	١٨٢,١٠	٥٥٥,٤٦	٠,٣٣	٠,٣٤	٥٤٢,٣٨
أيلول	٥٢٢,٢٠	٥٤٦,٣٠	٠,٩٦	٠,٩٨	٥٣٣,٤٤
ت ١	٦٨٧,٢٠	٥٣٩,٣٢	١,٢٧	١,٣٠	٥٢٦,٦٢
ت ٢	١٠٨٠,٣	٥٢٨,٥٨	٢,٠٤	٢,٠٩	٥١٦,١٣
ك ١	١٣٩١,٦	٥١٧,٢٠	٢,٦٩	٢,٧٦	٥٠٥,٠٢
السنة ٢-ك	٢٦٣,٩٠	٥١٧,٢١	٠,٥١	٠,٥٤	٤٩١,٩٤
شباط	٢٨٩,٩٠	٥١٩,٧٥	٠,٥٦	٠,٥٩	٤٩٤,٣٧
آذار	٣٣٧,٠٠	٥١٩,٤٠	٠,٦٥	٠,٦٨	٤٩٤,٠٣
نيسان	٣٧٤,٠٠	٥١٧,٥٣	٠,٧٢	٠,٧٦	٤٩٢,٢٥
أيار	٢٩٢,٧٠	٥١١,٦٦	٠,٥٧	٠,٦٠	٤٨٦,٦٧
حزيران	٣٩٨,٦٠	٥٠٤,١٦	٠,٧٩	٠,٨٣	٤٧٩,٥٣

تابع - الجدول رقم (٥).

التاريخ	المبيعات	MM١٢	النسبة	المعيار	المبيعات CVS
تموز	٤٢١,٧٠	٥٠٦,٠٥	٠,٨٣	٠,٨٨	٤٨١,٣٣
آب	١٧٣,٨٠	٥١٢,٥٥	٠,٣٤	٠,٣٦	٤٨٧,٥١
أيلول	٥٢٢,١٠	٥١٧,٤٦	١,٠١	١,٠٦	٤٩٢,١٨
ت١	٦٤٢,٤٠	٥٢٥,١٧	١,٢٢	١,٢٩	٤٩٩,٥٢
ت٢	٩٨٤,٢٠	٥٣٧,٧٥	١,٨٣	١,٩٢	٥١١,٤٩
ك١	١٣٠٧,٦	٥٥٠,١٣	٢,٣٨	٢,٥٠	٥٢٣,٢٦
السنة ٢-٣-ك٢	٣٩٣,٤٠	٥٥٥,٥٧	٠,٧١	٠,٧٠	٥٦٥,٤٣
شباط	٣١٦,٢٠	٥٥٦,٩٧	٠,٥٧	٠,٥٦	٥٦٦,٨٦
آذار	٤٢٨,٦٠	٥٥٩,٦٨	٠,٧٧	٠,٧٥	٥٦٩,٦٢
نيسان	٤٦٧,٦٠	٥٦٥,٠٥	٠,٨٣	٠,٨١	٥٧٥,٠٨
أيار	٥٠١,٠٠	٥٦٨,٥٢	٠,٨٨	٠,٨٧	٥٧٨,٦٢
حزيران	٤٨٧,٤٠	٥٧٢,٧٠	٠,٨٥	٠,٨٤	٥٨٢,٨٨
تموز	٤٦٣,٣٠	-	٠,٨٣	٠,٨٢	٥٦٥,٨٥
آب	١٦٥,٩٠	-	٠,٣٤	٠,٣٣	٤٩٧,٩٤
أيلول	٥٩٥,١٠	-	١,٠١	٠,٩٩	٦٠٠,٢٨
ت١	٦٩٨,١٠	-	١,٢٢	١,٢٠	٥٨٠,٨٥
ت٢	١٠١٣,٠٠	-	١,٨٣	١,٨٠	٥٦٢,٨٢
ك١	١٣٨٠,٠٠	-	٢,٣٨	٢,٣٤	٥٩٠,٩٠
المتوسط	٥٤٩,٢٤	-	-	-	٥٥٨,٠٧
الانحراف المعيارى	٣٢٥	-	-	-	٨٠,٥٥
معامل الاختلاف	٠,٥٩	-	-	-	٠,١٤

ج - تحليل الفصلية وفقاً للنمط التضاربي وباستخدام المعاملات الثابتة (الملف C2EX6):

يمكن للقارئ أن يقوم بنفسه بتحليل المركبة الفصلية باستخدام البرنامج Excel.

- طريقة أخرى لتخليص السلسلة من التأثير الفصلي CENSUS:

قام المحلل Shiskin المتخصص بتحليل الدورات الاقتصادية في عام ١٩٥٤ باقتراح طريقة لتخليص السلسلة من التأثير الفصلي باستخدام متكرر لعدة متوسطات متحركة. هذا الباحث الذي كان يعمل في مكتب التعداد العام للسكان CENSUS في الولايات المتحدة الأميركية أعطى اسم CENSUS-1 لطريقته تلك. ومنذ العام ١٩٥٤ تم العديد من التعديلات على تلك الطريقة بهدف تحسينها. فكان هناك CENSUS-2 و CENSUS-3 وفى عام ١٩٦٧ قام Shiskin بالتعاون مع Musgrave و Young باقتراح النسخة المسماة CENSUS-11 المستخدمة حالياً في كثير من مراكز البحوث. ومن المهم أن نشير أيضاً إلى التحسينات التي أدخلها عام ١٩٧٩ الباحث Dagum الذي اقترح النسخة CENSUS-11 ARMMI.

يمكن من خلال CENSUS-11 إجراء تحليل للمركبة الفصلية بواسطة المتوسطات المتحركة خاصة المتوسطات المتحركة من الدرجة ١٥ (معادلات Spencer). لقد انتشرت هذه الطريقة بشكل كبير وأصبح استخدامها واسعاً في العديد من مراكز الدراسات الإحصائية ولكن قليلاً في قطاع المنشآت. يتم في هذه الطريقة حساب المعاملات الفصلية المنزلة بهدف إدخال تعديلات بنيوية في المركبة الفصلية وهذا الإجراء مثير للشك كما سبق أن أشرنا.

ولأن طريقة CENSUS التي تستند - في توضيحها للمركبة الفصلية - إلى عمليات تكرارية متتالية لمتوسطات متحركة من درجات مختلفة تفقد الكثير من المعطيات على طرفي السلسلة: فإنها لهذا السبب لا يمكن استخدامها إلا من أجل السلاسل الزمنية للمبيعات ذات الفترات الزمنية الطويلة (١٠ سنوات) ومن ثم يحد هذا من استخدامها في قطاع المنشآت.

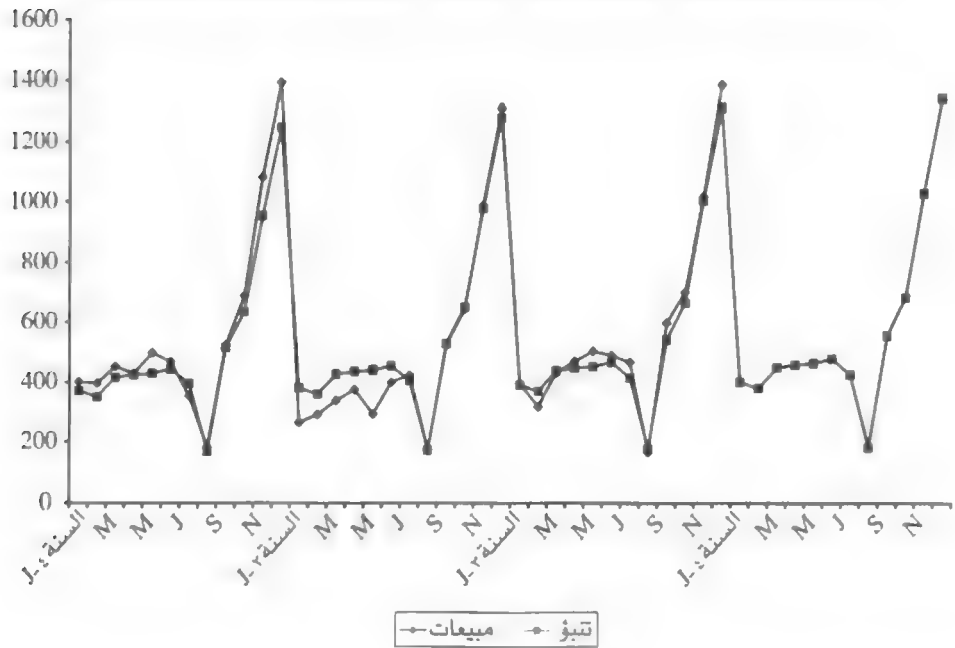
نستخلص مما سبق الصعوبة في تحليل المركبة الفصلية والحاجة إلى أدوات حساب آلية نظراً لأهمية تحليل التقلبات الموسمية ودورها الأساسي كمرحلة مهمة في تنفيذ التنبؤ.

- التنبؤ الأول بواسطة التمديد الخارجى لحركة الاتجاه العام وللمركبة الفصلية (الملف C2EX7):  
يوضح الرسم البيانى (٧) تنبؤاً تم حسابه بواسطة عملية التمديد الخارجى لمركبة الاتجاه العام وللمركبة الفصلية. ولقد تم سابقاً توضيح طريقة الحساب لكلتا المركبتين، ويمكن للقارئ، من أجل مزيد من التفاصيل، العودة للملف C2EX7.

### ٣-٥-٤- الاختبار الإحصائى للمركبة الفصلية:

قبل اللجوء إلى إجراء تصحيح لمسار السلسلة من التقلبات الفصلية لا بد من التأكد أولاً، من خلال اختبار ما، من وجود حركة فصلية ما فى السلسلة. ويعتبر اختبار فيشر من الاختبارات الأكثر استخداماً فى هذا المجال ويستند إلى تحليل التباين للعامل الشهرى (أو الفصلى) مقارنة بالتباين الإجمالى للسلسلة.

الشكل البيانى رقم (٧) التنبؤ بواسطة التمديد الخارجى للنزعة وللمركبة الفصلية



الفرضية المختبرة باستخدام اختبار فيشر هى التالية: هل إضافة المركبة الفصلية إلى مركبة الاتجاه العام سيحسن بشكل معنوى فى تفسير التقلبات فى السلسلة الخام؟ هنا يجب مقارنة:

- مجموع مربعات الانحرافات بين القيم الناتجة عن التنبؤ والقيم المحققة فعلاً للنموذج المتضمن فقط مركبة اتجاه عام.

- مع مجموع مربعات الانحرافات بين القيم الناتجة عن التنبؤ والقيم المحققة فعلاً للنموذج المتضمن مركبة اتجاه عام ومركبة فصلية.

وبعد ذلك نجرى اختبار فيشر باتباع الخطوات التالية:

١- نحسب مجموع مربعات الانحرافات للنموذج ذى مركبة الاتجاه العام فقط أى  $U^*$  من خلال تقدير معادلة الاتجاه العام الخطية التالية:  $T_t = \hat{a}_1 t + \hat{a}_0$  ومن ثم نحسب:

$$U^* = \sum_{t=1}^n (x_t - T_t)^2$$

يكون عدد درجات الحرية<sup>(١)</sup> لـ  $U^*$  هو  $ddl_{U^*}$  ويساوى  $n - 2$  (حيث تمثل  $n$  عدد المشاهدات) وذلك لأننا قدرنا معلمتين اثنتين فقط هما  $a_0$  و  $a_1$ .

٢- نحسب مجموع مربعات الانحرافات للنموذج ذى مركبة الاتجاه العام والمركبة الفصلية أى  $U^{**}$ . ومن أجل ذلك نجرى أولاً تقديراً للمعاملات الفصلية  $S_t$  ومن ثم نحسب:

$$U^{**} = \sum_{t=1}^n (x_t - (T_t \times S_t))^2$$

ويكون عدد درجات الحرية لـ  $U^{**}$  هو  $ddl_{U^{**}}$  ويساوى  $11 - 2 - n$  وذلك لأنه تم تقدير مؤشرين اثنين  $a_0$  و  $a_1$  و ١١ مؤشراً فصلياً (يستخلص المؤشر الثانى عشر من الأحد العشر الأخرى وفقاً لمبدأ الحفاظ على المدى).

٣- حساب القيمة التجريبية لاختبار فيشر:

$$F^* = ((U^* - U^{**})/11) / (U^{**}/(n-13))$$

(١) يتعلق مفهوم درجات الحرية بعدد القيم التى تبقى متاحة بعد إجراء التقدير الإحصائى. فإذا كان لدينا عينة مكونة من (١٠) مشاهدات وكان لدينا أيضاً متوسط العينة، فإننا لا نستطيع أن نختار بشكل حر القيم إلا من أجل تسع من هذه القيم، والمباشرة تستنتج من قيمة المتوسط. ومن ثم فإن عدد درجات الحرية هو  $n - 1 = 9$ .

تقارن القيمة السابقة المحسوبة من واقع البيانات لسلسلة المبيعات مع القيمة الجدولية النظرية لتوزيع فيشر المعطاة بجدول قانون توزيع<sup>(١)</sup> Fisher-Snedecor عند درجات الحرية الموافقة ( $v_1 = ddl_{U_0} - ddl_{U_{**}} = 11$  ،  $v_2 = ddl_{U_{**}} = n - 13$ ). فإذا كانت  $F^* > F$  حيث  $F$  تمثل القيمة الجدولية فإن السلسلة تحتوى على مركبة فصلية وفى الحالة المعاكسة لا وجود لمركبة فصلية.

فى حالة السلاسل الزمنية الطويلة (٤ سنوات من المعطيات الشهرية) يمكننا تقريب القيمة الجدولية إلى القيمة ٢. يبين الجدول رقم ٦ طريقة الحساب للاختبار السابق.

الجدول رقم (٦) اختبار الكشف عن الفصلية (الملف C2EX8)

التاريخ	المبيعات	$T_i$	مربع الانحرافات	$V_i/T_i$	$S_i$	مربع الانحرافات
السنة ١ - J	٤٠١,٦٠	٤١٨	٢٦٩	٠,٩٦	٠,٧٩	٥٣٣٠
F	٣٩٥,٧٠	٤٢٦	٨٨٩	٠,٩٣	٠,٧٦	٥١٧٤
M	٤٥١,٠٠	٤٣٣	٣٢٤	١,٠٤	٠,٨٥	٦٧٢٢
A	٤٣٧,٦٠	٤٤١	١٦٧	٠,٩٧	٠,٧٩	٦٠٤٢
M	٤٩٦,٨٠	٤٤٨	٢٣٨١	١,١١	٠,٩١	٨١٥٦
J	٤٦٧,٧٠	٤٥٦	١٤٩	١,٠٣	٠,٨٤	٧٢٢٩
J	٣٥٢,٣٠	٤٦٣	١٢٢٥٦	٠,٧٦	٠,٦٢	٤١٠٢
A	١٨٢,١٠	٤٧١	٨٣١٧٧	٠,٣٩	٠,٣٢	١٠٩٦
S	٥٢٢,٢٠	٤٧٨	١٩٥٣	١,٠٩	٠,٨٩	٩٠١٢
O	٦٨٧,٢٠	٤٨٦	٤٠٦٨٢	١,٤٢	١,١٦	١٥٦٠٦
N	١٠٨٠,٣	٤٩٣	٣٤٤٩٢٠	٢,١٩	١,٧٩	٣٨٥٦٧
D	١٣٩١,٦	٥٠٠	٧٩٤٠٥٩	٢,٧٨	٢,٢٧	٦٣٩٩٦
السنة ٢ - J	٢٦٣,٩٠	٥٠٨	٥٩٥٨٤	٠,٥٢	٠,٥٨	٩٩٨
F	٢٨٩,٩٠	٥١٥	٥٠٨٩٤	٠,٥٦	٠,٦٣	١٢٠٥
M	٣٣٧,٠٠	٥٢٣	٣٤٥٩٥	٠,٦٤	٠,٧٢	١٦٢٨

(١) الجداول الإحصائية معروضة فى نهاية الكتاب.

التاريخ	المبيعات	$T_i$	مربع الانحرافات	$V_i/T_i$	$S_i$	مربع الانحرافات
A	٣٧٤,٠٠	٥٣٠	٢٤٤٩١	٠,٧١	٠,٧٩	٢٠٠٥
M	٢٩٢,٧٠	٥٣٨	٦٠١٦٩	٠,٥٤	٠,٦١	١٢٢٨
J	٣٩٨,٦٠	٥٤٥	٢١٥٧٧	٠,٧٣	٠,٨٢	٢٢٧٨
J	٤٢١,٧٠	٥٥٣	١٧٢٣٧	٠,٧٦	٠,٨٥	٢٥٥٠
A	١٧٣,٨٠	٥٦٠	١٤٩٥٢٩	٠,٣١	٠,٣٥	٤٣٣
S	٥٢٢,١٠	٥٦٨	٢١٠٦	٠,٩٢	١,٠٣	٣٩٠٨
O	٦٤٢,٤٠	٥٧٥	٤٤٧٧	١,١٢	١,٢٥	٥٩١٧
N	٩٨٤,٢٠	٥٨٣	١٦٠٩٧٣	١,٦٩	١,٨٩	١٣٨٨٧
D	١٣٠٧,٦	٥٩٠	٥١٤٢٥٤	٢,٢١	٠,٧٤	٢٤٥١٣
السنة ٢ - J	٣٩٣,٤٠	٥٩٨	٤١٨٥٤	٠,٦٦	٠,٧٤	٢٤٥١
F	٣١٦,٢٠	٦٠٥	٨٣٦٨٤	٠,٥٢	٠,٥٩	١٥٨٣
M	٤٣٨,٦٠	٦١٣	٣٣٩٩٦	٠,٧٠	٠,٧٩	٢٩٠٩
A	٤٦٧,٦٠	٦٢٠	٢٣٣٧٢	٠,٧٥	٠,٨٥	٣٤٦٢
M	٥٠١,٠٠	٦٢٨	١٦١٢٣	٠,٨٠	٠,٩٠	٣٩٧٥
J	٤٨٧,٤٠	٦٣٥	٢١٩٢٧	٠,٧٧	٠,٨٦	٣٧٦٢
J	٤٦٣,٣٠	٦٤٣	٣٢٢٨٣	٠,٧٢	٠,٨١	٣٣٩٩
A	١٦٥,٩٠	٦٥٠	٢٣٤٨١٢	٠,٢٦	٠,٢٩	٤٣٦
S	٥٩٥,١٠	٦٥٨	٣٩٥٣	٠,٩٠	١,٠٢	٥٦٠٨
O	٦٩٨,١٠	٦٦٥	١٠٦٥	١,٠٥	١,١٨	٧٧١٧
N	١٠١٢,١٠	٦٧٣	١١٥٠٠٩	١,٥٠	١,٦٩	١٦٢٢١
D	١٣٨٠,٠٠	٦٨٠	٤٨٩٣٤٣	٢,٠٣	٢,٢٨	٣٠١٥٧
المجموع	١٩٧٧٣	$U^* = ٣٤٧٨٥٣٤$				$U^{**} = ٣١٣٢$

نحسب القيمة التجريبية لاختبار فيشر:

$$F^* = ((U' - U'')/11)/(U''/(n-13)) = ((3478534 - 313262)/11) (313262/(36-13)) = 21.13$$

وبالمقارنة مع القيمة الجدولية عند (١١ و ٢٣) درجة حرية المساوية لـ (٢.٢٤) نستنتج أن السلسلة تعاني من حركة فصلية (هذا يتفق مع ملاحظة الشكل البياني رقم ٦).

### ٣-٥-٥- المركبة الفصلية لمجموعة من السلع Famille de saisonnalité:

يكون من المفيد أحياناً حساب المعاملات الفصلية للسلسلة الزمنية الممتلئة لمجموعة من السلع وليس لسلسلة واحدة فحسب، ويجب أن تكون السلع ضمن المجموعة الواحدة متجانسة فيما بينها تجاه التقلبات الفصلية. والفائدة من ذلك تتلخص فيما يلى:

- تكون المعاملات الفصلية أكثر قوة كونها تحسب على مجموعة من السلع.
- إمكانية عزل التأثير المنفرد لسلسلة ما فى المركبة الفصلية لمجموعة السلع، ومثال ذلك التأثير الناتج عن عملية العروض الترويجية لسلسلة على المركبة الفصلية.
- يمكن للسلع الجديدة التى لا يتوافر معطيات سابقة حول مبيعاتها أن يتم ربطها بمجموعة ملائمة لها، ومن ثم إجراء التنبؤ لها مع الأخذ بعين الاعتبار للتغيرات الموسمية.

### ٣-٦- المركبة الدورية (الحلقية) La composante cyclique:

تعتبر مركبتا الاتجاه العام والفصلية من المركبات الأكثر وضوحاً فى مسار السلسلة الزمنية وخصوصاً فى المجال الاقتصادى. ولكن لو افترضنا سلسلة زمنية ذات تقلبات طفيفة فى مركبتى الاتجاه العام والحركة الفصلية أو فى حال تم تخليص السلسلة من هاتين المركبتين فإن التقلبات المتبقية فى السلسلة ليست إلا تقلبات عشوائية وأحياناً لها مدى وتردد منتظم أى شبيه بحركة حلقية مكونة من فترات زمنية طويلة (سنتين أو أكثر).

يعتبر التحليل الطيفي<sup>(١)</sup> الوسيلة الوحيدة المتخصصة فى تحليل المركبة الدورية، إذ يتم من خلاله تقسيم التقلبات إلى حلقات ذات فترات وسعات مختلفة.

إن الدورات المدروسة فى المجال الاقتصادى الكلى مثل دورات Kondratieff و Juglar و Kuznets لا يمكن ملاحظتها مباشرة فى الاقتصاد الجزئى وذلك لأن قطاعات ذلك الأخير تتأثر بدورات أقل طولاً.

(١) يمكن العودة إلى (١٩٩٨) Bourbonnais et Terraza الفصل الرابع.



تعتبر طرائق التحليل الطيفي المشتقة من علم الفيزياء والمستندة إلى سلاسل فورية *decomposition de Fourier* أسلوباً رياضياً طبيعياً لهذا المزج بين الانتظامية وغير الانتظامية فى السلسلة الزمنية. ويتم وفقاً لهذه الطريقة تفكيك السلسلة إلى مجموع منته من التوابع الجيبية ومن ثم حساب مساهمة كل منها فى التباين الإجمالى للسلسلة.

وعادة ما يتم تجاهل هذه المركبة الدورية لصعوبة إثبات وجودها من جهة أو لعدم توافر سلاسل زمنية طويلة تسمح باستخلاص هذه المركبة من جهة أخرى. بالنسبة لبعض الباحثين يتم معالجة المركبة الدورية باعتبارها مدمجة مع مركبة الاتجاه العام المتوسطة المدى وهذه المركبة المختلطة تسمى بالإنجليزية "trend-cycle". كما يمكن دمجها أيضاً مع مركبة البواقي، ومن ثم يمكن اعتبارها سلسلة مصفاة من حركتى الاتجاه العام والفصلية وتستخدم لهدف إجراء التنبؤ.

### ٣-٧- عامل البواقي *Le facteur résiduel*:

لو عدنا مرة أخرى إلى مخطط تفكيك السلسلة إلى مركباتها الأساسية:  $R_t = x_t - T_t - S_t - C_t$  فيمكننا عزل عامل البواقي على النحو التالى:  $R_t = x_t - T_t - S_t - C_t$  وهذه المركبة الأخيرة تمثل التقلبات غير المنتظمة للسلسلة الزمنية العائدة لحوادث عرضية متفرقة. ومن المفيد معرفة ما إذا كانت هذه التقلبات تتعلق بحوادث عشوائية بحتة بالمعنى الفوصى للكلمة (توقع رياضى معدوم، تماثل بالتوزيع بالنسبة للمتوسط وثبات للتباين) أو فيما إذا كانت خاضعة لتوزيع احتمالى معين نستطيع من خلاله إعادة إنتاج هذه المركبة. يمكننا هنا التمييز بين التعبيرين: عنصر البواقي *résiduel* وعنصر العشوائية *aléatoire* على النحو التالى:

- عنصر البواقي: هو العنصر الذى نستطيع أن نجد له قانوناً احتمالياً يمكننا من إعادة تكوينه.

- عنصر عشوائى: لا يمكن تفسيره بواسطة أى قانون احتمالى.

ولكى نستطيع التمييز بين الحالتين يتم حساب ما يسمى بـ *corrélogramme*<sup>(١)</sup> (أو تابع الارتباط الذاتى الخطى) الذى يعطى توضيحاً لطبيعة هذا العنصر.

(١) حساب هذا التابع وتفسيره سيكون معالجا فى الفصل التالى.

## الفصل الثالث

### الطرائق الأساسية للتنبؤ (١)

### الطرائق المستندة إلى الصقل الأسى

أدى تطور التقنيات الإحصائية إلى بروز عدد كبير من أدوات الحساب المختلفة، وفى هذا الفصل سنعرض تلخيصاً للطرائق التنبؤية المستندة إلى مبدأ الصقل الأسى  $Lissage\ Exponentiel$  وهى تعتمد على أسلوب التمديد الخارجى لإجراء التنبؤ. وسنشير باختصار ضمن الحدود الدنيا إلى الأساس النظرى الضرورى لفهم كل طريقة. أما بالنسبة للقارئ المهتم بتفاصيل أكثر فيمكن له العودة إلى المراجع المشار إليها لاحقاً.

لقد استُخدمت تقنيات الصقل الأسى لأول مرة فى عام ١٩٥٧ من قبل الباحث Holt وبعد ذلك من قبل Brown عام ١٩٦٢. ويشمل الصقل مجموعة من التقنيات التجريبية التى لها هدف مشترك هو إعطاء تنبؤات (أوزان) للقيم الحديثة من السلسلة الزمنية بشكل أكبر من باقى قيم السلسلة.

#### ١- خصائص طرائق الصقل الأسى:

##### ١-١- مبادئ أساسية:

- المبدأ الأول - التناقض المطرد لمعلومات السلسلة مع قدمها:

تستند طريقة الصقل الأسى إلى أولية مفادها أن المعلومات المحتواة فى السلسلة الزمنية تكون أكثر أهمية للمعطيات الحديثة، ومن ثم لإجراء التنبؤ يجب إعطاء أوزان للمعطيات الحديثة أكبر من تلك المعطاة للمعطيات البعيدة زمنياً (القديمة).

- المبدأ الثانى - مبدأ تلخيص المعلومات:

إن المعلومات المتوافرة فى السلسلة الزمنية كبيرة بحيث لا يمكن معالجتها بشكل كامل، ولذلك فإن طريقة الصقل الأسى تلخص هذه المعلومات بواسطة بضعة مؤشرات أو معالم ومن ثم يكفى لإجراء التنبؤ بواسطة هذه التقنية اعتبار هذه القيم فقط.

- المبدأ الثالث - مبدأ إعادة التحديث المستمر للمؤشرات:

تسمح طريقة الصقل الأسى بالتحديث المستمر للمعاملات بالتردد الزمنى نفسه (الدورية) التى وجدت فيه عند وصول المعلومات. ويعتبر هذا المبدأ نتيجة مرتبطة بالمبدأين السابقين.

سنبرهن الآن على المبادئ السابقة.

### ٢-١- العرض الرياضى:

لنفترض أن  $x_t$  تمثل المبيعات من منتج ما فى الزمن  $t$  وهذه المبيعات يمكن اعتبارها نتيجة لتوفيق خطى غير منتبه من القيم السابقة لسلسلة المبيعات مع افتراض التأثير المتناقص للماضى على الحاضر كلما أصبح هذا الأخير أكثر قدماً.

ولنستخدم الترميز التالى:

$x_t$ : قيمة محققة من سلسلة المبيعات  $x$  عند الزمن  $t$  (وليكن شهراً ما على سبيل المثال).

$S_t$ : القيمة المصقولة للسلسلة الزمنية.

$\hat{x}_t$ : التنبؤ المحسوب فى اللحظة  $t$  للفترة المستقبلية  $t+1$  للسلسلة  $x_t$ ، أى يجب مقارنة  $x_t$  مع  $\hat{x}_{t-1}$ .

$a$ : معامل الصقل حيث  $a \in [0,1]$ .

يمكننا من خلال المبدأ الأساسى للصقل الأسى أن نكتب بالنسبة لـ  $\hat{x}_t$ :

$$(1) \quad \hat{x}_t = S_t = \hat{x}_{t-1} + a (\hat{x}_t - \hat{x}_{t-1})$$

وهكذا فإن الصقل يبدو كأنه النتيجة للقيمة الأخيرة المصقولة والمصححة بتثقيل للانحراف بين المحقق والمتنبئ به. ومن ثم فنحن بصدد المبدأ الثالث المتعلق بالتوافق بين الصقل وخطأ التنبؤ.

يمكن تعديل العلاقة (١) على الشكل التالى:

$$(2) \quad \hat{x}_t = a x_t + (1 - a) \hat{x}_{t-1}$$

يبدو من خلال العلاقة السابقة أن الصقل يمثل وسيلة مثقلة بالقيمة الأخيرة المحققة للسلسلة وبالقيمة الأخيرة المصقولة.

للقوف على تأثير المعامل  $a$  فإننا نفترض فى العلاقة الأولى أن:

١ -  $a = 1$  ومن ثم  $\hat{x}_t = \hat{x}_{t-1}$  وهذا يعنى أن المشاهدات الجديدة لم تؤخذ بعين الاعتبار عند حساب التنبؤات، ومن ثم فإن الصقل يكون ساكناً مقارنة بالقيم المحققة للسلسلة وتكون التنبؤات دون تغيير.

١ -  $a = 1$  ومن ثم تكون  $\hat{x}_t = x_t$  وعليه فإن النموذج يتبع المعلومات الأخيرة للسلسلة، وتكون القيمة المصقولة الجديدة مساوية دائماً للقيمة الأخيرة المحققة ويدعى الصقل فى هذه الحالة بأنه ذو حساسية عالية hyper réactif.

يمكن إجراء تعديل فى العلاقة (٢) من خلال تفكيك الزمن  $(0, ..., t-n, t-2, t-1, t)$  وجعل القيمة الجديدة المصقولة  $\hat{x}_t$  كتوفيق خطى لكل المشاهدات السابقة المثقلة بأوزان متناقصة مع الزمن. وهذه التثقيات تتناقص شيئاً فشيئاً كلما ابتعدنا عن المشاهدة الحالية.

$$(٣) \quad \hat{x}_t = a x_1 + a(1-a)x_{t-1} + a(1-a)^2 x_{t-2} + a(1-a)^3 x_{t-3} + \dots + a(1-a)^{n-1} x_{t-n+1} + (1-a)^n x_0$$

وهكذا نكون برهنا على المبدأين الأساسيين الأوليين:

- كون المعامل  $a$  يراوح بين ٠ و ١، فإن التثقيات المعطاة للقيم تتناقص بشكل هندسى كما هو موضح بالجدول (١) والشكل البيانى (١).
- تتضمن القيمة الأخيرة المصقولة كل المعلومات التاريخية للسلسلة بشكل تركيبى.

الجدول رقم (١) تناقص المعلومات مع قدمها ومقارنة بين المتوسط التقليدى وقيمة محددة لمعامل الصقل

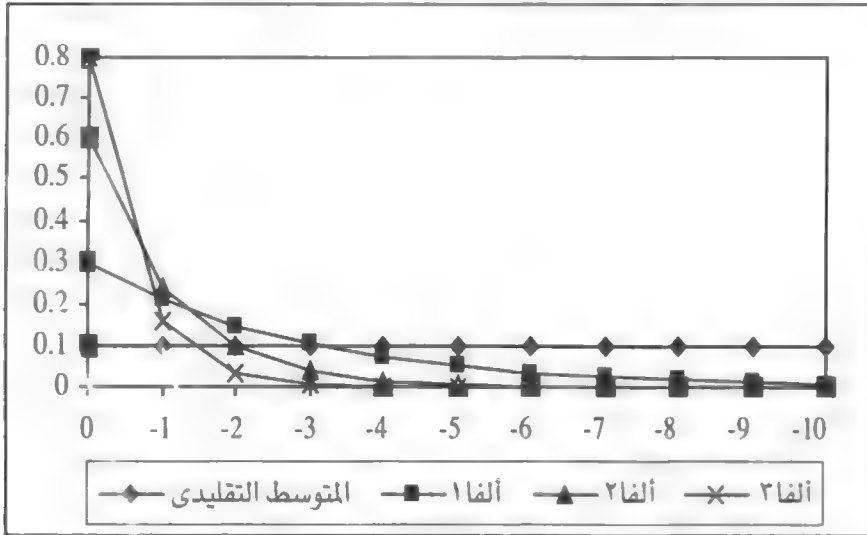
الزمن	المتوسط التقليدى	التثقيـل	تثقيـل هندسى متناقص من أجل $a = 0.30$
٠	٠,١	$a$	٠,٣٠
-١	٠,١	$a(1-a)^1$	٠,٢١
-٢	٠,١	$a(1-a)^2$	٠,١٥
-٣	٠,١	$a(1-a)^3$	٠,١٠
-٤	٠,١	$a(1-a)^4$	٠,٠٧
-٥	٠,١	$a(1-a)^5$	٠,٠٥

تابع - الجدول رقم (١).

الزمن	المتوسط التقليدي	التثقييل	تثقييل هندسي متناقص من أجل $a = 0.30$
-٦	٠,١	$a(1-a)^6$	٠,٠٤
-٧	٠,١	$a(1-a)^7$	٠,٠٢
-٨	٠,١	$a(1-a)^8$	٠,٠٢
-٩	٠,١	$a(1-a)^9$	٠,٠١
-١٠	٠,١	$a(1-a)^{10}$	٠,٠١

من أجل  $a = 0.30$  تثقل القيمة الأخيرة من السلسلة  $x_t$  بالقيمة  $(٠,٢)$ ، والقيمة قبل الأخيرة  $(x_{t-1})$  بالقيمة  $(٠,٢١)$  (هذا يعني أن ٢١٪ من قيمتها يساهم في حساب التنبؤ) وهكذا بالنسبة للقيم الأخرى. اعتباراً من القيمة الثامنة  $(x_{t-8})$  يصبح معامل التثقييل أقل من  $(٠,٠٢)$ .

الشكل البياني رقم (١) تناقص المعلومات مع قدمها ومقارنة بين المتوسط التقليدي وثلاث قيم لمعامل الصقل  $(a_3 = 0.8, a_2 = 0.6, a_1 = 0.3)$ .



### ١-٣- دور ثابت الصقل:

لقد رأينا سابقاً النتائج المترتبة على اختيار قيمتين مختلفتين لمعامل الصقل:  $a = 0$  و  $a = 1$ . إذن لا بد من حل وسط ما بين الثبات الذى يعنى مسح للتغيرات العشوائية البحتة وبين السرعة فى الاستجابة لإصلاح التقلبات فى مركبة الاتجاه العام. يسمى المعامل  $a$  بثابت الصقل ويلعب دوراً مهماً:

- فعندما تكون  $a$  قريبة من الصفر فإن التثقل يمتد إلى عدد كبير من الحدود السابقة، وتكون ذاكرة الظاهرة المدروسة قوية ويكون التنبؤ قليل الحساسية للملاحظات الأخيرة.
- عندما تكون  $a$  قريبة من الواحد فإنه يكون للملاحظات الأكثر حداثة أوزان تزيد على تلك التى للحدود القديمة من السلسلة، وتكون ذاكرة الظاهرة المدروسة ضعيفة والصقل شديد الحساسية لقيم الملاحظات الأخيرة.

من الممكن حساب الفترة المتوسطة للحساسية، التى يسميها بعض الباحثين بالعمر المتوسط للمعلومة، من خلال المتوسط المثلث لمعاملات الصقل. وهى تعطى بالعلاقة التالية:

$$\bar{D} = \frac{1-a}{a}$$

فإذا كانت  $a = 1$  فإن العمر المتوسط للمعلومة يكون معدوماً: لأنه تم الأخذ بعين الاعتبار للقيمة الأخيرة فقط، وإذا كانت  $a = 0$  فإن العمر المتوسط يكون غير منتهٍ، ذلك لأن القيمة الابتدائية فقط تم اعتبارها.

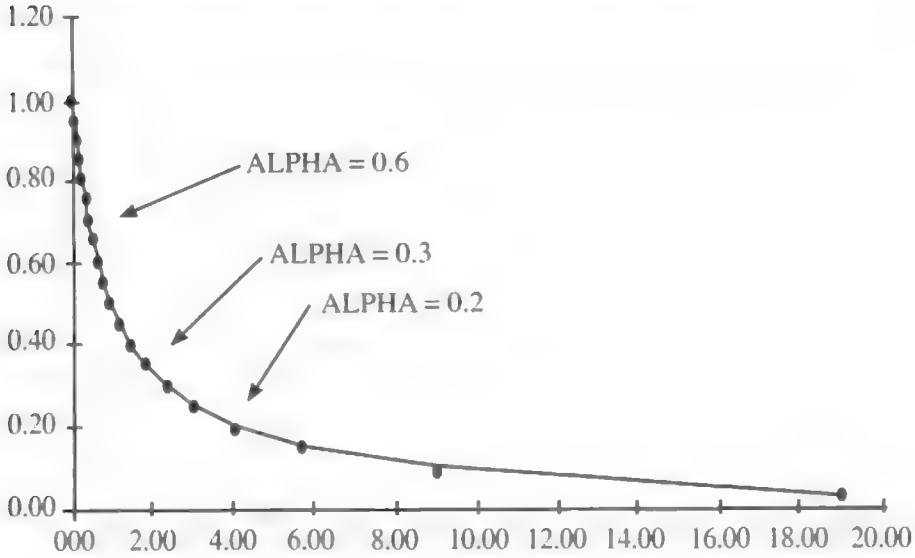
يلعب الصقل دوراً فى تخفيض التباين ويبرهن على العلاقة التالية:

$$\frac{Var(\hat{x}_t)}{Var(x_t)} = \frac{a}{2-a}$$

فإذا كانت  $a = 0$  فإن  $\hat{x}_t$  ذات تباين معدوم (وذلك لأن التنبؤ ثابت مهما كانت قيم  $x_t$ ) وإذا كانت  $a = 1$  فإن  $\hat{x}_t$  تمتلك التباين نفسه لـ  $x_t$  (القيمة الجديدة المصقولة تساوى القيمة المحققة الأخيرة).

فى الشكل البيانى (٢)، مثّلنا على محور العينات النسبة  $\left(\sqrt{\frac{a}{2-a}}\right)$  وهى تمثل العلاقة ما بين الانحراف المعياري للسلسلة المصقولة وبين الانحراف المعياري للسلسلة الخام وفى الوقت نفسه تمثل دور عملية الفلترة للصقل فى حين تم وضع عمر الصقل  $\bar{D}$  (العمر المتوسط للمعلومات) تبعاً لعدة قيم لـ  $a$  على محور السينات.

الشكل البياني رقم (٢) قيمة معامل الصقل، العمر المتوسط للمعلومة والفترة



نفهم من خلال قراءة المنحنى السابق سبب الاختيار المتكرر للقيمة (٠.٢) كمعامل للصقل فعندما يكون معامل الصقل أقل من (٠.٢٠) يزداد عمر الصقل (محور السينات) بسرعة كبيرة دون ربح يذكر للمرشح (الفلتر) واعتباراً من القيمة (٠.٤) تنخفض جودة المرشح بسرعة كبيرة مع انخفاض بسيط في العمر المتوسط.

نعود فيما بعد في الفقرة ٥ إلى معالجة الاختيار الأمثل لمعامل أو معاملات الصقل.

## ٢- الصقل الأسى البسيط: النموذج المستقر Le modèle stationnaire:

تُكتب صيغ الصقل البسيط على النحو التالي:

$$\hat{x}_t = S_t = a x_t + (1-a) \hat{x}_{t-1}$$

مع افتراض  $\hat{x}_t = x_t$  باعتبارها قيمة ابتدائية يكون التنبؤ المحسوب في اللحظة n الأخيرة لـ h فترة زمنية مستقبلية مساوياً لـ:

$$\hat{x}_{n+h} = \hat{x}_n \quad \forall h$$

مما يعنى ثبات التنبؤ مهما كان مجال التنبؤ.

يظهر الجدول ٢ التالى كيفية الحساب.

الجدول رقم (٢) التنبؤ بواسطة نموذج الصقل الأسى البسيط

$e_t = x_t - \hat{x}_t$	$\hat{x}_t$	$x_t$	$t$
٠	٣٠,٠٠	٣٠	١
٧	٣٣,٠٠	٤٠	٢
٤,٩	٣٥,١٠	٤٠	٣
٣,٥٧-	٣٣,٥٧	٣٠	٤
٩,٥-	٢٩,٥٠	٢٠	٥
٦,٦٥-	٢٦,٦٥	٢٠	٦
٢,٣٥	٢٧,٦٥	٣٠	٧
١,٦٤	٢٨,٣٦	٣٠	٨
-	٢٨,٣٦	-	٩
-	٢٨,٣٦	-	١٠
-	٢٨,٣٦	-	١١

تم استخدام  $\hat{x}_1 = x_1 = 30$  قيمة ابتدائية ومن أجل  $t = 2$  (التنبؤ محسوب عند  $t = 1$  من أجل  $t = 2$ ) يكون لدينا:

$$\hat{x}_2 = 0.3 \times x_2 + 0.7 \times \hat{x}_1 = 0.3 \times 40 + 0.7 \times 30 = 33$$

$$\hat{x}_3 = 0.3 \times 40 + 0.7 \times 33 = 35.10 \quad t = 3 \text{ ومن أجل } t = 3$$

....

$$\hat{x}_8 = 0.3 \times 30 + 0.7 \times 27.65 = 28.36 \quad t = 8 \text{ ومن أجل } t = 8$$

$$\hat{x}_9 = \hat{x}_{10} = \hat{x}_{11} = 28.36 \quad t = 9, 10, 11 \text{ ومن أجل } t = 9, 10, 11$$

يمكن لمن يرغب - على سبيل المثال - تحميل الملف C3EX1 وإجراء عملية المحاكاة المطلوبة.



يبدو من عمليات المحاكاة أنه في حال تأثر السلسلة بحركة اتجاه عام فإن عملية الصقل الأسّي البسيط تكون فاشلة ولأنه في حالة التنبؤ بالمبيعات تكون السلاسل الزمنية غالباً متأثرة بحركة اتجاه عام صاعدة أو هابطة فإن استخدام الصقل البسيط غير فعال، ونستخدم بدلاً منه الصقل الأسّي المضاعف الذي يأخذ بعين الاعتبار حركات الاتجاه العام.

### ٣- الصقل الأسّي المضاعف: النموذج الخطي Le modèle linéaire:

يمكننا من خلال العلاقات المعروضة في الفقرة السابقة حساب التنبؤات للسلاسل الزمنية المستقرة أي التي لا تحتوى على حركة اتجاه عام. وهنا سنستعرض طريقة الصقل الأسّي المضاعف التي تسمح بوجود مركبة اتجاه عام.

يطبق نموذج الصقل الأسّي المضاعف (LED)<sup>(١)</sup> على السلاسل الزمنية المثلة على النحو التالي:

$$x_t = a_{0t} + a_{1t} t$$

نلاحظ أن للعلاقة السابقة التعريف نفسه المتعلق بمستقيم الاتجاه العام (الفصل ٢) والمتوسط  $\hat{a}_{0t}$  والنزعة (ميل المستقيم  $\hat{a}_{1t}$ ) يتحركان مع الزمن.

وكما يشير اسم تلك الطريقة فإن التقنية المستخدمة فيها تقضى بإجراء صقل للسلسلة التي سبق أن تم صقلها مسبقاً.

يبرهن<sup>(٢)</sup> على صحة العلاقات التالية:

$$S_t = a x_t + (1-a) S_{t-1}$$

$$SS_t = a S_t + (1-a) SS_{t-1} \quad (\text{من هنا تسمية الصقل المضاعف})$$

$$\begin{cases} a_{1t} = \frac{a}{1-a} (S_t - SS_t) \\ a_{0t} = 2S_t - SS_t \end{cases}$$

ويكون التنبؤ للمجال الزمني  $h$  معطى بالعلاقة التالية:  $\hat{x}_{t+h} = a_{0t} + a_{1t} \times h$ .

(١) Lissage Exponential Double.

(٢) العودة إلى Bourbonnais et Terraze ١٩٩٨ الصفحة ٥٥.

يبين الجدول (٣) طريقة الحساب للتنبؤ بواسطة الصقل الأسى المضاعف باعتبار  $(a = 0.3)$ . كما تبين الأشكال البيانية (٣ و٤) التنبؤ بواسطة الصقل الأسى على المعطيات المأخوذة من الجدول (٣) باعتبار  $a = 0.1$  و  $a = 0.9$  (يعتبر التنبؤ دالة للتقديرات المعطاة للقيم السابقة القريبة والبعيدة).

الجدول رقم (٣) التنبؤ بواسطة الصقل الأسى المضاعف باعتبار  $a = 0.3$  (الملف C3EX2.XLS)

الزمن	المبيعات CVS	S	S	$a_1$	$a_0$	التنبؤ
السنة ١ - J	٧٢٨١	٧٢٨١,٠٠	٧٢٨١,٠٠	٠,٠٠	٧٢٨١,٠٠	
F	٩١٦٣	٧٨٤٥,٦٠	٧٤٥٠,٣٨	١٦٩,٣٨	٨٢٤٠,٨٢	٧٢٨١,٠٠
M	٧٧٦٩	٧٨٢٢,٦٢	٧٥٦٢,٠٥	١١١,٦٧	٨٠٨٣,١٩	٨٤١٠,٢٠
A	٨٤٨٥	٨٠٢١,٣٣	٧٦٩٩,٨٤	١٣٧,٧٨	٨٣٤٢,٨٣	٨١٩٤,٨٦
M	٧٦٠٦	٧٨٩٦,٧٣	٧٧٥٨,٩١	٥٩,٠٧	٨٠٣٤,٥٦	٨٤٨٠,٦٢
J	٧٣٦٤	٧٧٣٦,٩١	٧٧٥٢,٣١	٦,٦٠-	٧٧٢١,٥٢	٨٠٩٣,٦٣
J	٦٧١١	٧٤٢٩,١٤	٧٦٥٥,٣٦	٩٦,٩٥-	٧٢٠٢,٩٢	٧٧١٤,٩٢
A	٦٨٩٤	٧٢٦٨,٦٠	٧٥٣٩,٣٣	١١٦,٠٣-	٦٩٩٧,٨٧	٧١٠٥,٩٧
S	٥٦٧٨	٦٧٩١,٤٢	٧٣١٤,٩٦	٢٢٤,٣٧-	٦٢٦٧,٨٨	٦٨٨١,٨٤
O	٧٦٠٦	٧٠٢٥,٧٩	٧٢٣١,٢١	٨٣,٧٥٠	٦٨٤٠,٣٨	٦٠٤٣,٥١
N	٧٣٦٤	٧١٢٤,٢٦	٧٢٠٢,١٢	٢٩,٠٩-	٧٠٦٦,٣٩	٦٧٥٦,٦٣
D	٩٧٨٩	٧٩٣٠,٦٨	٧٤٢٠,٦٩	٢١٨,٥٧	٨٤٤٠,٦٧	٧٠٣٧,٣٠
السنة ٢ - J	٨٠٨٢	٧٩٧٦,٠٧	٧٥٨٧,٣٠	١٦٦,٦٢	٨٣٦٤,٨٥	٨٦٥٩,٢٤
F	٨٦٦٣	٨١٨٢,١٥	٧٧٦٥,٧٦	١٧٨,٤٥	٨٥٩٨,٥٥	٨٥٣١,٤٦
M	٧٧٢٠	٨٠٤٣,٥١	٧٨٤٩,٠٨	٨٣,٢٢	٨٢٣٧,٩٣	٨٧٧٧,٠٠
A	٧٨٥٩	٧٩٨٨,١٥	٧٨٩٠,٨٠	٤١,٧٢	٨٠٨٥,٥٠	٨٣٢١,٢٥
M	٦٩٣٦	٧٦٧٢,٥١	٧٨٢٥,٣٢	٦٥,٤٩-	٧٥١٩,٧٠	٨١٢٧,٢٣
J	٦٢٩٢	٧٢٥٨,٣٦	٧٦٥٥,٢٣	١٧٠,٠٩-	٦٨٦١,٤٨	٧٤٥٤,٢١
J	٧٥٧٢	٧٣٥٢,٤٥	٧٥٦٤,٣٩	٩٠,٨٣-	٧١٤٠,٥٠	٦٦٩١,٤٠
A	٦٧٤٣	٧١٦٩,٦١	٧٤٤٥,٩٦	١١٨,٤٣-	٦٨٩٣,٢٧	٧٠٤٩,٦٧
S	٧١٥٢	٧١٦٤,٣٣	٧٣٦١,٤٧	٨٤,٤٩-	٦٩٦٧,١٩	٦٧٧٤,٨٣

تابع - الجدول رقم (٣).

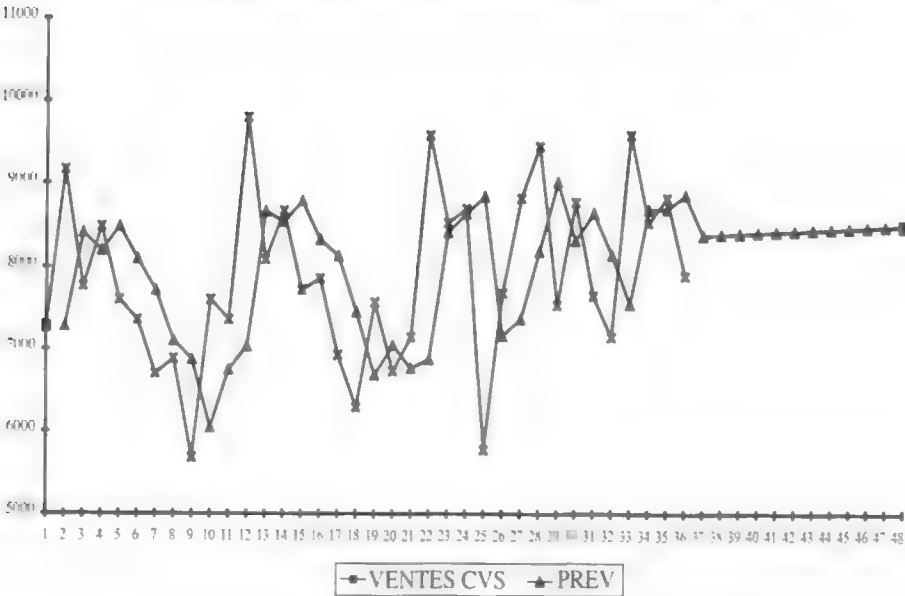
الزمن	المبيعات CVS	S	S	$a_1$	$a_0$	التنبؤ
O	٩٥٦٧	٧٨٨٥.١٣	٧٥١٨.٥٧	١٥٧.١٠	٨٢٥١.٦٩	٦٨٨٢.٧٠
N	٨٥٢٢	٨٠٧٦.١٩	٧٦٨٥.٨٦	١٦٧.٢٩	٨٤٦٦.٥٣	٨٤٠٨.٧٩
D	٨٦٨٨	٨٢٥٩.٧٣	٧٨٥٨.٠٢	١٧٢.١٦	٨٦٦١.٤٥	٨٦٣٣.٨١
السنة ٢ - J	٥٧٧٢	٧٥١٣.٤١	٧٧٥٤.٦٤	١٠٣.٣٨-	٧٣٧٢.١٩	٨٨٣٣.٦١
F	٧٦٨٢	٧٥٦٣.٩٩	٧٦٩٧.٤٤	٥٧.١٩-	٧٤٣٠.٥٤	٧١٦٨.٨١
M	٨٨١٤	٧٩٣٨.٩٩	٧٧٦٩.٩١	٧٢.٤٦	٨١٠٨.٠٨	٧٣٧٣.٣٤
A	٩٤٣٢	٨٣٨٦.٨٩	٧٩٥٥.٠٠	١٨٥.١٠	٨٨١٨.٧٩	٨١٨٠.٥٤
M	٧٥٤١	٨١٣٣.١٣	٨٠٠٨.٤٤	٥٣.٤٤	٨٢٥٧.٨١	٩٠٠٣.٨٨
J	٨٧٦٥	٨٣٢٢.٦٩	٨١٠٢.٧٣	٩٤.٢٧	٨٥٤٢.٦٦	٨٣١١.٣٥
J	٧٦٥٠	٨١٢٠.٨٨	٨١٠٨.١٧	٥.٤٥	٨١٣٣.٦٠	٨٦٣٦.٩٤
A	٧١٥٢	٧٨٣٠.٢٢	٨٠٢٤.٧٨	٨٣.٣٨-	٧٦٣٥.٦٥	٨١٣٩.٠٥
S	٩٥٦٧	٨٣٥١.٢٥	٨١٢٢.٧٣	٩٧.٩٤	٨٥٧٩.٧٨	٧٥٥٢.٢٧
O	٨٥٢٢	٨٤٠٣.٤٨	٨٢٠٦.٦٥	٨٣.٩٣	٨٥٩٨.٣٠	٨٦٧٧.٧٢
N	٨٨١٤	٨٥٣٥.٩٣	٨٣٠٢.٤٣	٩٥.٧٩	٨٧٤٩.٤٣	٨٦٨٢.٢٣
D	٧٨٩٢	٨٣٣٥.٧٥	٨٣١٢.٤٣	١٠.٠٠	٨٣٥٩.٠٨	٨٨٤٥.٢٢
السنة ٤ - J	-	-	-	-	-	٨٣٦٩.٠٧
F	-	-	-	-	-	٨٣٧٩.٠٧
M	-	-	-	-	-	٨٣٨٩.٠٦
A	-	-	-	-	-	٨٣٩٩.٠٦
M	-	-	-	-	-	٨٤٠٩.٠٦
J	-	-	-	-	-	٨٤١٩.٠٥
J	-	-	-	-	-	٨٤٢٩.٠٥
A	-	-	-	-	-	٨٤٣٩.٠٤
S	-	-	-	-	-	٨٤٤٩.٠٤
O	-	-	-	-	-	٨٤٥٩.٠٤
N	-	-	-	-	-	٨٤٦٩.٠٣
D	-	-	-	-	-	٨٤٧٩.٠٣

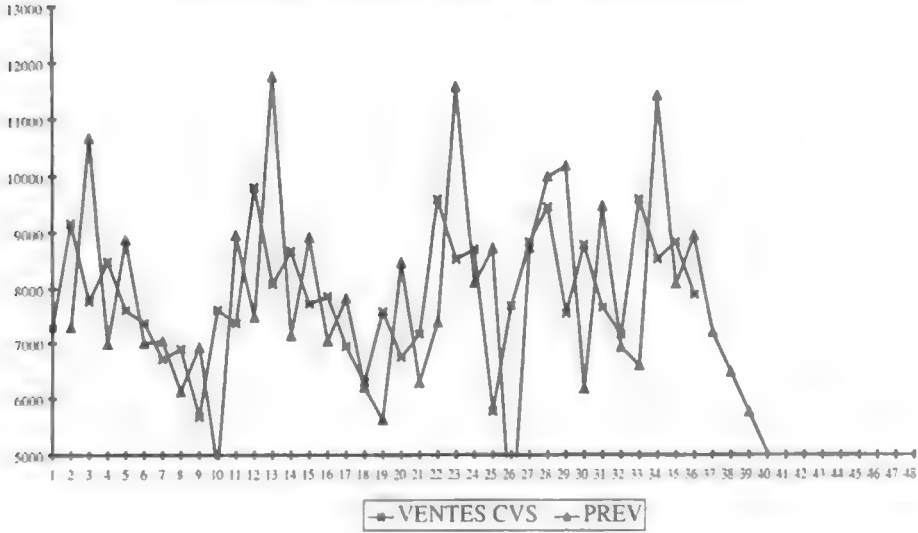
تفاصيل الحساب لعناصر الجدول السابق مشروحة ضمن خلايا الحساب في ملف المعطيات المشار إليه سابقاً.

من خلال ملاحظة الرسمين البيانيين تتضح فكرة الصقل الأسى من الأوجه التالية:

- يلاحظ بشكل عام استجابة التنبؤ للتغيرات في مسار السلسلة مع بعض التأخير وهذه الظاهرة تسمى «سباق التتابع» بين القيم المحققة والقيم المتنبأ بها.
- هناك استجابة سريعة جداً للمنحنى المرسوم باستخدام المعامل (٠,٨) على التقلبات المفاجئة وهذا من شأنه، عند إجراء التنبؤ، تضخيم مركبة الاتجاه العام المرتبطة بالمشاهدة الأخيرة.
- التنبؤات المحسوبة في الحالتين مختلفة بشكل واضح، ومن ثم فإن التغير في معامل الصقل يقود إلى نتائج غير متجانسة وغير ثابتة. وهذه الرسوم البيانية تظهر المحدودية لطريقة الصقل الأسى.

الشكل البياني رقم (٣) التنبؤ بواسطة الصقل الأسى مع  $\alpha = 0.1$



الشكل البياني رقم (٤) التنبؤ بواسطة الصقل الأسى مع  $a = 0.9$ 

#### ٤- نماذج Holt و Holt-Winters:

##### ٤-١- نموذج Holt:

تسمى النماذج التي استعرضناها في الفقرة السابقة بنماذج Brown ويمكننا أيضاً استخدام نموذج صقل Holt الذي يشتمل على معامل صقل: واحد للمتوسط المصقول  $a_{0t}$  والآخر لميل المستقيم  $a_{1t}$ .

يتم إجراء الصقلين المنفصلين التاليين:

- صقل المتوسط  $a_{0t}$  مع معامل صقل  $a$ ,  $a \in [0,1]$ .
  - صقل لمركبة الاتجاه العام  $a_{1t}$  مع معامل صقل  $\beta$ ,  $\beta \in [0,1]$ .
- (في الحالة حيث  $a = \beta$  يكون نموذج Holt هو نفسه نموذج الصقل المضاعف لـ Brown).

العرض الرياضي:

نستخدم لصقل المتوسط العلاقة التالية:  $a_{0t} = ax_t + (1-a)(a_{0t-1} + a_{1t-1})$

(تمثل  $a_{0t-1} + a_{1t-1}$  المتوسط الجديد المصقول عند  $t$ ).

نستخدم لصقل مركبة الاتجاه العام العلاقة التالية:

$$a_{1t} = \beta (a_{0t} - a_{0t-1}) + (1-\beta)a_{1t-1}$$

ويكون التنبؤ المحسوب عند  $t$  للمجال الزمني  $h$  فترة مساوياً لـ:

$$\hat{x}_{t+h} = a_{0t} + ha_{1t}$$

حيث تمثل  $x_t$  القيمة الملاحظة للسلسلة عند  $t$ .

القيم الابتدائية (من أجل  $t = 1$ ):

- القيمة الابتدائية للمتوسط المصقول:  $a_{01} = x_1$

- القيمة الابتدائية للنزعة:  $a_{11} = 0$

بعد ذلك يمكن استخدام العلاقات العامة. ويمكن الرجوع للملف C2EX2 من أجل التمرين، في حين سيتم في الفقرة القادمة استعراض مثال كامل حول كيفية استخدام نموذج Holt-Winters.

#### ٢-٤- النموذج المتضمن مركبة الاتجاه العام والمركبة الفصلية (نموذج Holt-Winters):

تمتاز طريقة الصقل لنموذج Holt-Winters بإمكانية إدخال المركبة الفصلية في نموذج التنبؤ، ومن ثم إجراء التنبؤ بعملية واحدة وتستند معظم البرمجيات الخاصة بحساب التنبؤ بالمبيعات إلى هذه الطريقة. إذ يتم إجراء ثلاث<sup>(١)</sup> عمليات صقل على النحو التالي:

- الصقل للمتوسط بمعامل الصقل  $a$  حيث  $a \in [0,1]$ .

- الصقل للنزعة بمعامل صقل  $\beta$  حيث  $\beta \in [0,1]$ .

- الصقل للمركبة الفصلية باستخدام معامل صقل  $\gamma$  حيث  $\gamma \in [0,1]$ .

العرض الرياضي:

يتم الصقل للمتوسط بالعلاقة التالية:  $a_{0t} = a(x_t / S_{t-P}) + (1-a)(a_{0t-1} + a_{1t-1})$

(تم استخدام  $S_{t-P}$  لأن  $S_t$  ليست معلومة بعد).

(١) في حال عدم وجود مركبة فصلية فإننا نستخدم نموذج Holt ذي المرحلتين: الصقل للمتوسط والصقل للنزعة.

يتم الصقل لمركبة الاتجاه العام بالعلاقة التالية:  $a_{1t} = \beta(a_{0t} - a_{0t-1}) + (1-\beta)a_{1t-1}$

ويتم الصقل للمركبة الفصلية بواسطة العلاقة:  $S_t = \gamma(x_t/a_{0t}) + (1-\gamma)S_{t-p}$

ومن ثم فإن التنبؤ للمجال الزمنى  $h$  يعطى بالعلاقة التالية:

$$1 \leq h \leq p \text{ إذا كانت } \hat{x}_{t+h} = (a_{0t} + ha_{1t}) S_{t-p+h}$$

$$p+1 \leq h \leq 2p \text{ إذا كانت } \hat{x}_{t+h} = (a_{0t} + ha_{1t}) S_{t-p+2h}$$

حيث:

$a_{0t}$ : المتوسط المصقول للسلسلة فى الزمن  $t$ .

$x_t$ : القيمة المشاهدة للسلسلة فى الزمن  $t$ .

$S_t$ : المعامل الفصلية فى الزمن  $t$ .

$p$ : دورية المعطيات (الفترة الفاصلة بين المشاهدة والأخرى وهى تساوى ١٢ للمعطيات الشهرية و٤ للمعطيات الفصلية).

$a_{1t}$ : ميل مركبة الاتجاه العام المقدرة فى الزمن  $t$ .

القيم الابتدائية (للسنة الأولى،  $t = 1, p$ ):

- القيم الابتدائية للمركبة الفصلية.

يتم تقدير المعاملات الفصلية للسنة الأولى بواسطة القيمة المشاهدة فى الزمن  $t$  أى  $(x_t)$  مقسمة على المتوسط  $\bar{x}$  للملاحظات  $p$  الأولى (الخاصة بالسنة الأولى).

$$S_t = x_t / \bar{x} \text{ من أجل } t = 1, p$$

- القيم الابتدائية للمتوسط المصقول:  $a_{0p} = \bar{x}$

- القيمة الابتدائية للنزعة:  $a_{1p} = 0$

يبين الجدول (٤) عملية حساب التنبؤ بواسطة نموذج Holt-Winters وتعلق المعطيات بالمبيعات لمنج ذى استخدام يتعلق بفترة أعياد.

الجدول رقم (٤) حساب التنبؤ بواسطة نموذج Holt-Winters:  
 باستخدام  $\gamma = 0.2, \beta = 0.1, \alpha = 0.3$  (الملف C3EX4)

الزمن	المبيعات	$a_{1,t}$	$a_{2,t}$	$S_t$	$\hat{x}_t$
السنة ١ - J	٤٠١.٦٠	-	-	٠.٧٠	-
F	٣٩٥.٧٠	-	-	٠.٦٩	-
M	٤٥١.٠٠	-	-	٠.٧٩	-
A	٤٢٧.٦٠	-	-	٠.٧٥	-
M	٤٩٦.٨٠	-	-	٠.٨٧	-
J	٤٦٧.٧٠	-	-	٠.٨٢	-
J	٣٥٢.٣٠	-	-	٠.٦٢	-
A	١٨٢.١٠	-	-	٠.٣٢	-
S	٥٢٢.٢٠	-	-	٠.٩١	-
O	٦٨٧.٢٠	-	-	١.٢٠	-
N	١٠٨٠.٣	-	-	١.٨٩	-
D	١٢٩١.٦	٠.٠	٥٧١.٣	٢.٤٤	-
السنة ٢ - J	٢٦٣.٩٠	٥.٩-	٥١٢.٦	٠.٦٧	-
F	٢٨٩.٩٠	٨.٥-	٤٨٠.٣	٠.٦٧	٢٥٠.٩٣
M	٣٢٧.٠٠	٩.٩-	٤٥٨.٣	٠.٧٨	٣٧٢.٣٨
A	٣٧٤.٠٠	٨.٣-	٤٦٣.٨	٠.٧٦	٣٢٥.٦١
M	٢٩٢.٧٠	١١.٩-	٤١٩.٨	٠.٨٤	٣٩٦.٠٦
J	٣٩٨.٦٠	٩.٥-	٤٣١.٦	٠.٨٤	٣٣٣.٩٤
J	٤٢١.٧٠	١.٧-	٥٠٠.٦	٠.٦٦	٢٦٠.٢٨
A	١٧٣.٨٠	٠.٣-	٥١٢.٩	٠.٣٢	١٥٩.٠٤
S	٥٢٢.١٠	١.٥	٥٣٠.٢	٠.٩٣	٤٦٨.٥١
O	٦٤٣.٤٠	١.٦	٥٣٢.٤	١.٢٠	٦٣٩.٤٨
N	٩٨٤.٢٠	١.١	٥٣٩.٩	١.٨٨	١٠٠٩.٥٩
D	١٣٠٧.٦	١.٣	٥٣٢.٨	٢.٤٤	١٢٩٣.٥٠



تابع - الجدول رقم (٤).

الزمن	المبيعات	$a_{1v}$	$a_{1t}$	$S_t$	$\hat{x}_t$
السنة ٢ - J	٢٩٢.٤٠	٥٥١.٢	٣.٠	٠.٦٧	٣٥٥.٣٥
F	٣١٦.٢٠	٥٢٨.٦	٠.٥	٠.٦٦	٣٧٤.٠٥
M	٤٢٨.٦٠	٥٣٥.٥	١.١	٠.٧٨	٤١١.٩١
A	٤٦٧.٦٠	٥٦٠.٢	٣.٥	٠.٧٧	٤٠٧.٨٢
M	٥٠١.٠٠	٥٧٤.٦	٤.٦	٠.٨٤	٤٧٠.٧٠
J	٤٨٧.٤٠	٥٧٩.٥	٤.٦	٠.٨٤	٤٨٦.٢١
J	٤٦٣.٣٠	٦١٨.٩	٨.١	٠.٦٨	٣٨٦.٥٦
A	١٦٥.٩٠	٥٩٣.١	٤.٧	٠.٣١	٢٠٢.٣٧
S	٥٩٥.١٠	٦١٠.٨	٦.٠	٠.٩٤	٥٥٤.٨٤
O	٦٩٨.١٠	٦٠٥.٨	٤.٩	١.١٩	٧٤٢.٣٥
N	١٠١٢.١٠	٥٨٨.٦	٢.٧	١.٨٥	١١٥٠.٥٥
D	١٣٨٠.٠٠	٥٨٣.٦	١.٩	٢.٤٢	١٤٤٢.٤٠
السنة ٤ - J	-	-	-	-	٣٩٥.٢٢
F	-	-	-	-	٣٨٧.٤١
M	-	-	-	-	٤٦١.٤٣
A	-	-	-	-	٤٥٨.٢١
M	-	-	-	-	٤٩٩.٧٤
J	-	-	-	-	٤٩٩.٨٢
J	-	-	-	-	٤٠٥.٤٦
A	-	-	-	-	١٨٨.١٦
S	-	-	-	-	٥٦٣.٢٣
O	-	-	-	-	٧١٩.٣١
N	-	-	-	-	١١١٩.٤٠
D	-	-	-	-	١٤٧٠.٦٨

نماذج من عملية الحساب<sup>(١)</sup>:

قيمة ابتدائية:  $\bar{x} = 571.34$  (للسنة الأولى)

المركبة الفصلية:  $S_{avr-Annee1} = 427.60/571.43 = 0.75$

المتوسط:  $a_{0 dec-Annee1} = 571.34$

النزعة:  $a_{1 dec-Annee1} = 0$

هنا مجال التنبؤ  $h$  تم اختياره مساوياً للواحد ويكون لدينا من أجل شهر سبتمبر من العام ٢:

$$a_{0 sep-Annee2} = 0.3 (522.1/0.91) + 0.7 (512.9 - 0.3) = 530.2$$

$$a_{1 sep-Annee2} = 0.1 (530.2/512.9) + 0.9 \times -0.3 = 1.5$$

$$S_{sep-Annee2} = 0.2 (522.1/530.2) + 0.8 \times 0.691 = 0.93$$

$$\hat{x}_{sep-Annee2} = (512.9 + (-0.3) \times 1) 0.91 = 468.51$$

بالنسبة لحساب التنبؤ في العلاقة الأخيرة فقد تم حسابه في شهر آب من العام ٢ باعتبار  $h = 1$ .

التنبؤ لشهر سبتمبر من العام ٤ ( $h = 9$ ) المحسوب في شهر ديسمبر من العام ٣ يساوى:  $\hat{x}_{sep-Annee4} = (583.6 + 1.9 \times 9) 0.94 = 653.23$ .

## ٥- كيفية اختيار معامل الصقل:

### ٥-١- مبادئ عامة:

لا بد عند البدء في عملية الصقل من اختيار قيمة لمعامل الصقل الذي سبق أن رمزنا له بالرمز  $a$  (على سبيل المثال القيمة ٠,٢) ويلعب اختيار قيمة معامل الصقل دوراً مهماً في عملية الصقل: لأن ذلك يقيد التنبؤات المستقبلية من خلال درجة التثقيل التي نعملها للماضي القريب وللماضي البعيد من السلسلة.

(١) قد تظهر بعض الفروقات الطفيفة وذلك لأن البرنامج يأخذ عدداً كبيراً من الأرقام العشرية بعد الفاصلة.

هناك عدة طرائق لتقدير هذا المعامل والأكثر استخداماً تقضى باختيار تلك القيمة التى تجعل الانحراف بين المتنبأ به والمحقق على الجزء المعلوم من السلسلة فى حدوده الدنيا (الفقرة ٢-٥). وهناك طريقة أخرى تقضى باستخدام عمليتى ضبط ومراقبة لاستخدام هذا المعامل ومن ثم إمكانية تعديله. وهكذا فإنه فى حالة عدم التقارب للتنبؤ فإنه يتم تعديل قيمة معامل الصقل بشكل آلى بحيث يتلاءم مع التغير الهيكلى الحاصل (الفقرة ٢-٥).

### ٢-٥- قيمة $a$ التى تجعل مجموع مربعات أخطاء التنبؤ فى حده الأدنى:

تتميز هذه الطريقة ببساطتها. فلاستخدامها يكفى إعطاء مجال لبعض القيم لمعامل الصقل  $a \in (a_1, a_2)$  والسير بخطوات صغيرة (٠.٠٥ على سبيل المثال) وإجراء التنبؤات عند كل قيمة ومن ثم حساب مجموع مربعات أخطاء التنبؤ. ونأخذ قيمة معامل الصقل التى تجعل مجموع مربعات الانحرافات فى حدودها الدنيا. يمكن تعميم هذه الطريقة لحساب معاملات الصقل الثلاثة  $(a, \beta, \gamma)$ . يمكننا استخدام الدالة "SOLVEUR" فى البرنامج إكسل لحل هذه المشكلة ببساطة.

يمكن تلخيص هذه الطريقة على النحو التالى:

نبحث عن قيمة معامل الصقل التى تخفض إلى أدنى حد المجموع التالى لانحرافات أخطاء التنبؤ السابقة:

$$\text{Min} \sum_{i=1}^n e_i^2 = \sum_{i=1}^n (x_i - \hat{x}_i)^2$$

ونفترض من أجل ذلك أن:  $a_2 = 0.6, a_1 = 0.1$  وبخطوة تساوى (٠.٠٥).

أى نعتبر القيم  $a = 0.1, a = 0.15, a = 0.20, \dots, a = 0.6$  ومن ثم فإن قيمة

$a$  المختارة هى تلك التى تجعل المجموع  $\sum_{i=1}^n (x_i - \hat{x}_i)^2$  فى حدوده الدنيا.

يمكن على سبيل المثال البحث عن معاملات الصقل المثلث فى نموذج Holt-Winters الموجود فى الملف C3EX5.

تعتبر هذه الطريقة فى اختيار معامل الصقل مثلى من وجهة نظر طريقة المربعات الصغرى. لكن على الرغم من ثقتنا فى إيجاد القيمة الأفضل لهذا المعامل على إجمالى فترة التقدير (أى على الفترة السابقة). فإننا لسنا متأكدين من أفضلية تلك القيمة فى اللحظة حيث يتم حساب التنبؤ ومن أجل ذلك نستخدم الطريقة التالية.

### ٣-٥- طريقة ضبط معامل الصقل:

#### ٣-٥-١- مبادئ عامة:

يتم تحديد القيمة المثلى لمعامل الصقل عبر حل وسط بين القصور المتحقق نتيجة إدخال المعطيات البعيدة زمنياً وبين الحساسية للقيم الجديدة فى السلسلة.

فى حال ظهور خطأ للتنبؤ فإنه يمكن أن يكون عائداً إلى واحد من التفسيرين التاليين:

- وجود حادث ما غير متوقع ومن ثم يجب تخفيض المعامل  $a$  لعزل تأثير القيمة غير الطبيعية الناتجة عن هذا الحادث.

- وجود انقطاع فى مركبة الاتجاه العام ذات الاستمرارية الطويلة ومن ثم فإن المعامل  $a$  يجب رفعه لإعادة وصل هذا الانقطاع وبشكل سريع.

تعتبر عملية التسوية بين هاتين الفرضيتين صعبة ولنأخذ المثال التالى لسلسلة زمنية من المبيعات تتميز بوجود اضطرابين اثنين:

- انقطاع فى مركبة الاتجاه العام اعتباراً من الفترة ١٣.

- وجود قيمة شاذة للفترات الزمنية ٢٥ و ٢٦.

نحسب تنبؤاً لهذه السلسلة بواسطة الصقل الأسى المضاعف باستخدام  $a = 0.1$  و  $a = 0.5$  (الشكل البياني ٥).

ومن خلال التدقيق فى هذا الرسم نلاحظ ما يلى:

إذا كانت  $a = 0.1$  فإن ردة الفعل على التغيرات فى مركبة الاتجاه العام وإعادة التصحيح تكون طويلة. بالمقابل فإن هذا المعامل يسمح بمسح فعال للاضطراب الحاصل نتيجة القيم غير الطبيعية.

أما إذا كانت  $a = 0.5$  فإنه يتم توفيق النموذج بشكل سريع وجيد مع المتوسط الجديد ولكن حساسيته تجعل ردة فعله قوية جداً على الاضطراب الحاصل نتيجة القيم ٢٥ و ٢٦ غير الطبيعية.

من خلال ما سبق نستخلص أن المعامل الأفضل هو الذى يتمتع بقدرته على التحرك مع الزمن!

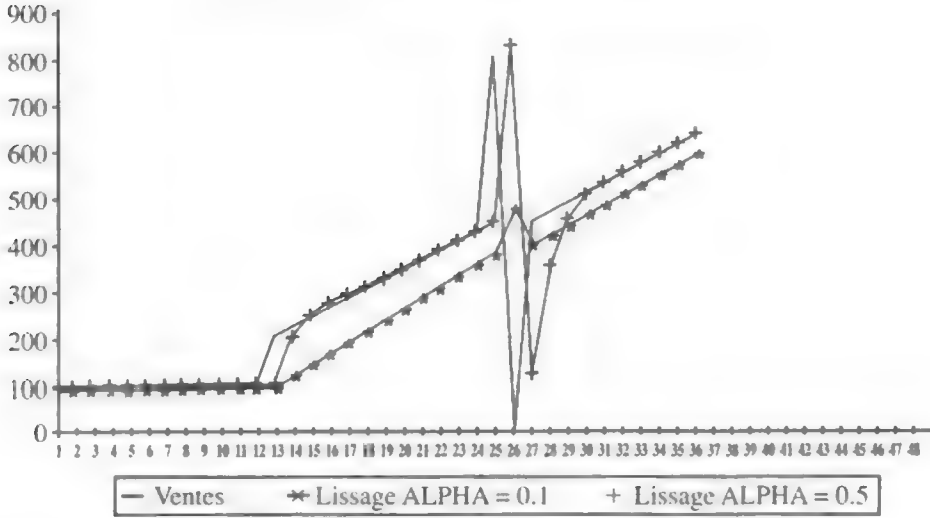
لنكتب من جديد نموذج الصقل الأسى البسيط المعرف بالمعادلة التالية:

$$\hat{x}_t = ax_t + (1 - a) \hat{x}_{t-1}$$

حيث تمثل  $\hat{x}_t$  القيمة الفعلية المحققة من السلسلة  $x$  (أى المبيعات) فى الزمن  $t$  (شهر معين مثلاً).

وتمثل  $\hat{x}_t$  التنبؤ للسلسلة  $x_t$  للفترة  $t + 1$  والمحسوب عند الزمن  $t$ . أما  $a$  فهى معامل الصقل الذى ينتمى للمجال  $[0,1]$ .

الشكل البياني رقم (٥) مثال للتنبؤ حيث  $a = 0.5$  و  $a = 0.1$



ونحاول ضبط معامل الصقل بشكل آلى عند كل فترة زمنية  $t$  بحيث نأخذ بعين الاعتبار إما الماضى السابق مباشرة وإما القيم السابقة الأكثر قدماً.

يمكننا من أجل ذلك تصور النموذج التالى:

$$\hat{x}_t = a_t x_t + (1 - a_t) \hat{x}_{t-1}$$

الذى يأخذ بعين الاعتبار إمكانية تغير قيمة معامل الصقل فى كل لحظة  $t$  عبر نظام ضبط محدد.

### ٥-٣-٢- متغيرات المراقبة Les variables de contrôle

سوف نستخدم الترميز التالى:

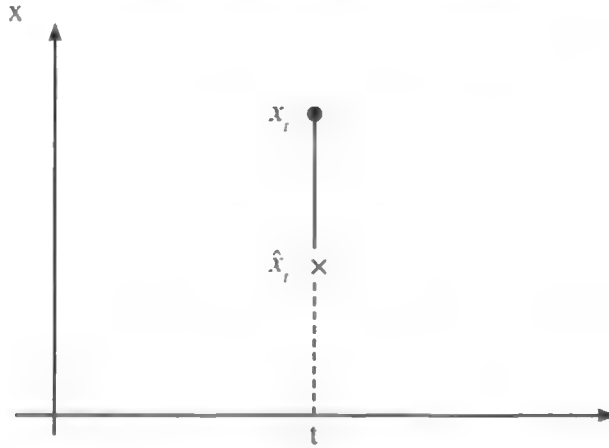
قيم السلسلة الزمنية الممثلة للمبيعات التى نرغب فى إجراء التنبؤ حولها.  $x_1, x_2, \dots, x_t$

$\hat{x}_1, \hat{x}_2, \dots, \hat{x}_t$ : القيم المتنبأ بها للسلسلة السابقة بواسطة عملية التنبؤ  $\hat{x}_t$ .  
 فى الأشكال البيانية التالية سوف ترمز النقاط المتصالبة إلى القيم الفعلية المحققة  $\hat{x}_t$  والنقاط فقط إلى القيم المتنبأ بها  $x_t$ .

- مؤشر الانحراف اللحظى ( $EPS_t$ ):

يعتبر الانحراف بين القيمة المتنبأ بها والقيمة الحقيقية فى الفترة الزمنية  $t$  أول ما يتبادر للذهن كوسيلة للحكم حول جودة نظام التنبؤ (الشكل البيانى ٦)  $EPS_t = x_t - \hat{x}_t$ .

الشكل البيانى رقم (٦) مؤشر الانحراف اللحظى



- مؤشر القيمة التجميعية للانحرافات ( $SUMEPS$ , مجموع  $EPS$ ):

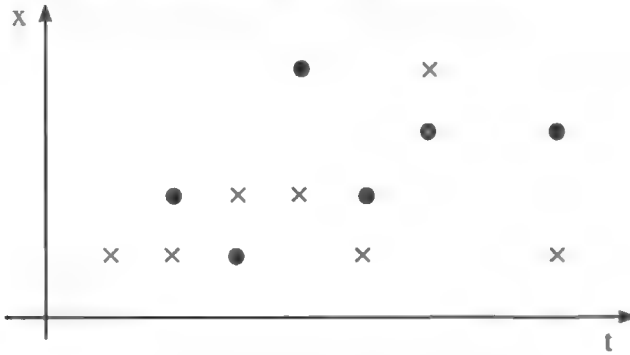
لتكن لدينا  $T$  فترة تنبؤ متتابعة (على سبيل المثال التنبؤات الـ ١٢ الأخيرة) وعليه يساوى المؤشر:

$$|SUMEPS_t| = \sum_{i=t-T+1}^t EPS_i$$

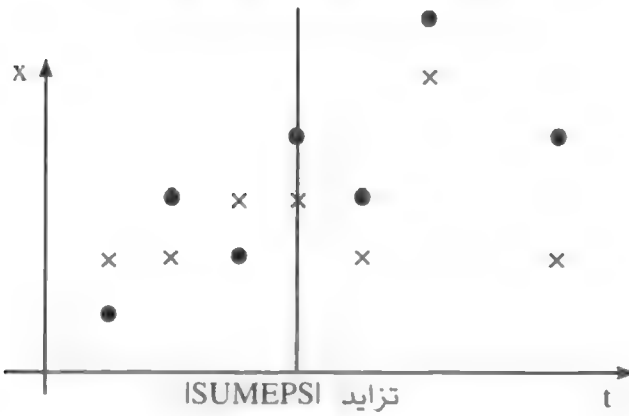
فى حال توزع المشاهدات (القيم الفعلية) بشكل منتظم حول التنبؤات فإن قيمة  $SUMEPS$  تكون فى كل لحظة قريبة من القيمة صفر (الشكل البيانى ٧).

بينما فى حالة التزايد بالقيمة المطلقة للمؤشر  $SUMEPS$  اعتباراً من فترة زمنية محددة فإن ذلك يشير إلى تغير فى حركة الاتجاه العام أو فى مستوى السلسلة نفسها (الشكل البيانى ٨).

الشكل البياني رقم (٧) توزيع منتظم فى خطأ التنبؤ



الشكل البياني رقم (٨) التنبؤ المتحيز



- مؤشر القيمة المطلقة المتوسطة للانحرافات (Mean Absolute Deviation):

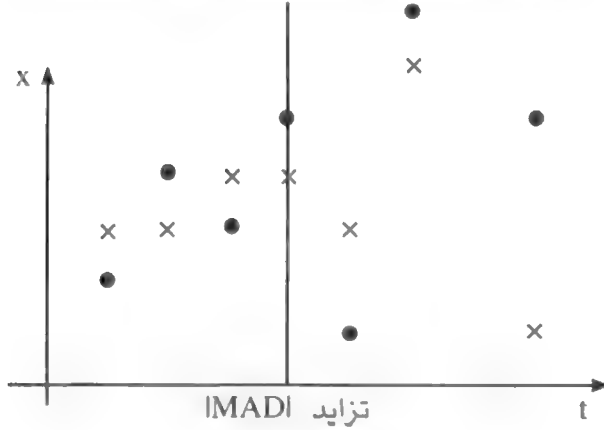
يعرف هذا المؤشر فى اللحظة  $t$  على النحو التالى:

$$MAD_t = \frac{\sum_{i=t-T+1}^t |EPS_i|}{T}$$

يعتبر هذا المؤشر من مقاييس التشتت ويشابه الانحراف المعيارى اللحظى لانحرافات التنبؤ.

عند زيادة  $EPS$  فإن قيمة  $MAD$  تتزايد ومن ثم فإن خطأ مرتفعاً غير طبيعي للتنبؤ يؤدي إلى زيادة فورية في قيمة المؤشر  $MAD$  وهذا يحصل بالنسبة للملاحظات الشاذة غير الطبيعية (الشكل ٩).

الشكل البياني رقم (٩) زيادة المؤشر  $MAD$  مع الزمن  $t$



لا يمكن الحكم على التغير اللحظي في المؤشر  $EPS$  إلا من خلال نسبته إلى التقلبات المتوسطة في السلسلة (فانحراف لحظي من ٥ إلى ١٠٪ يمكن اعتباره كافياً لسلسلة تتميز بتذبذبات شديدة ولكنه غير طبيعي بالنسبة للسلاسل المستقرة نوعاً ما). من أجل ذلك، يكون مفضلاً إجراء مقارنة دورية للمؤشر  $EPS$  والمؤشر  $SUMEPS$  مع مؤشر الانحراف المتوسط  $MAD$  وهذا يقود إلى إشارتين للضبط هما  $NF$  و  $AWS$ .

- الإشارة  $NF$  (Normal Forecast):

$$|NF| = \frac{EPS_t}{MAD_t} \quad \text{تعرف بالعلاقة التالية:}$$

وتشابه هذه الإشارة المتغير المركزي المخفض (الذي يمكننا الحصول عليه عبر استبدال  $MAD_t$  في العلاقة السابقة بالانحراف المعياري لانحرافات التنبؤ).

وهذا المؤشر حساس جداً للملاحظات الشاذة غير الطبيعية (فإذا كانت  $|EPS_t|$  مرتفعة فإن تكون  $|NF_t|$  أيضاً مرتفعة).



- الإشارة AWS (Alert Warning Signal):

$$|AWS_t| = \frac{SUMEPS_t}{MAD_t} \quad \text{وتعرف بالصيغة التالية:}$$

فى حالة التغير فى مركبة الاتجاه العام، فإن المجموع الجبرى لانحرافات التنبؤ هو من الإشارة نفسها لعدة فترات زمنية أى أن التنبؤ لا يتلاءم بشكل مناسب مع القيم المحققة فعلياً ويعمل الفلتر SUMEPS على تجميع هذه الانحرافات وتزداد قيمة  $|AWS|$ .

٥-٣-٣- تطبيق:

- حالة وجود تغير فى حركة الاتجاه العام (الشكل البيانى ١٠):

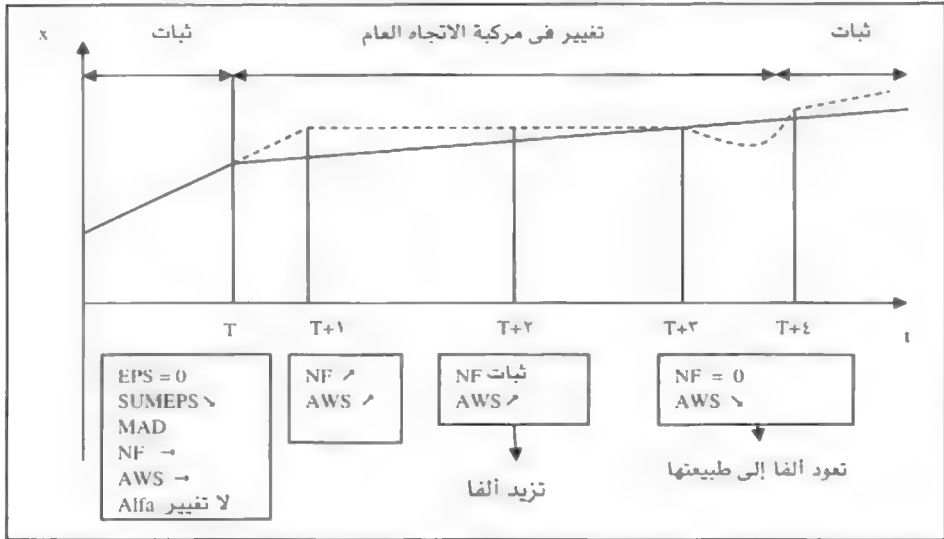
من ملاحظة الشكل ١٠ نجد أنه حتى الفترة  $T$  لا يوجد أية زيادة فى أى من المؤشرات، ومن ثم فإن قيمة  $a$  تبقى ثابتة. واعتباراً من الفترة  $T + 1$  يكون للمجموع الجبرى للأخطاء الإشارة نفسها لعدة فترات زمنية ومن ثم فإن التنبؤ يعتبر متحيزاً. وبالنسبة للفلتر SUMEPS فسيعتبر تلك الانحرافات تراكمية نظامية وستزداد قيمة NF عند الفترة الأولى للتغير الهيكلى ويمكن بعد ذلك أن تبقى ثابتة أو تحافظ على تطورها، أما إشارة الانحراف AWS فستدفع معامل الصقل  $a$  نحو الزيادة باعتبار التثقيل المعطى للمعلومة الأخيرة ضعيفاً جداً.

- حالة وجود عارض أو حادث من النمط المتعلق بالحالة الاقتصادية (الشكل البيانى ١١):

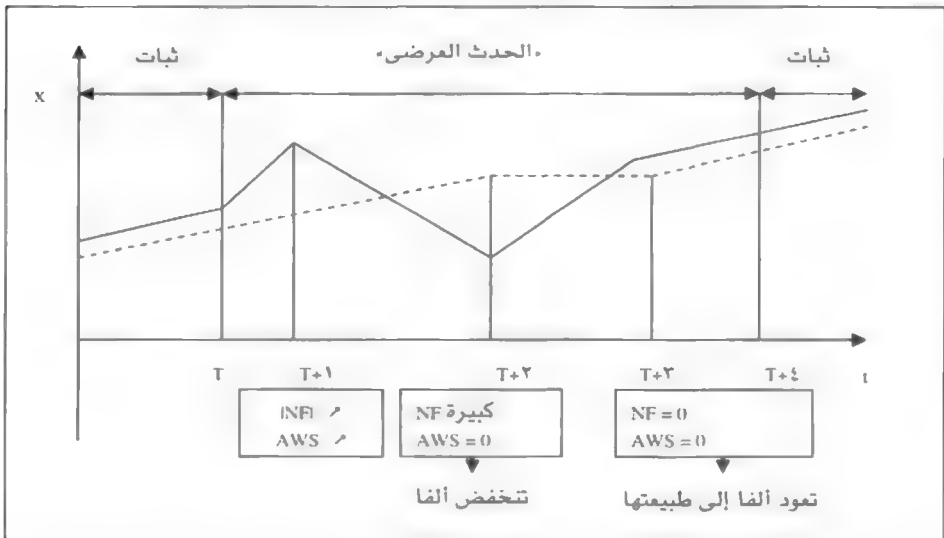
تكون الظاهرة فى هذه الحالة سريعة الزوال ولا يكون للأخطاء صفة منتظمة ولكن يمكن اعتبارها غير طبيعية (الفلتر MAD). تزداد قيمة AWS عند الفترة الأولى ويمكن أن تستمر ثابتة أو يمكن أن تنتهى إلى العدم فى حالة الانحرافات المتتابة المهمة ذات الإشارات المختلفة.

تمثل NF هنا إشارة الانحراف التى تقود انخفاضاً فى معامل الصقل  $a$  باعتبار أن للتثقيل الممنوح للمعلومة الأخيرة وزناً مهماً جداً كونها تتعلق بحادث ما.

الشكل رقم (١٠) تغيير في مركبة الاتجاه العام



الشكل رقم (١١) حدث عرضي ذو صلة بالحالة الاقتصادية



- عودة التواء التنبؤ مع المركبة الجديدة للاتجاه العام بعد زوال القيمة غير الطبيعية:  
في هذه الحالة، تعود قيمة  $a$  التي سبق أن خضعت إلى تغيرات سابقة مهمة إلى  
مستواها عند البدء (القيمة الأساسية لـ  $a$ ).

## - الإجراء العملى لاستخدام الطريقة:

مما سبق يتضح أن المؤشر NF يدل على وجود قيمة غير طبيعية (شاذة) ومن ثم فإن الزيادة فى قيمة ذلك المؤشر تستلزم تخفيض قيمة معامل الصقل. أما المؤشر AWS فيسمح بالكشف عن الانقطاعات فى مركبة الاتجاه العام ومن ثم فإن ارتفاع قيمة هذا المؤشر يستلزم زيادة قيمة معامل الصقل.

السؤال المطروح الآن هو كيفية التوفيق بشكل فعال ما بين المئومتين السابقتين. تسمح الطريقة المشروحة فى جدول القرار (الجدول ٥) بالإجابة عن هذه المسألة. فانطلاقاً من درجات تجريبية محددة<sup>(١)</sup>، نعرف ثلاث شرائح لقيم NF (فى الأعمدة) وAWS (فى الأسطر):

- تكون NF ضعيفة إذا كانت قيمتها أقل من (١.٥) ومن ثم فإن رمز NF هو (١).
  - تكون NF متوسطة إذا كانت قيمتها محصورة بين (١.٥ و ٢) ومن ثم فإن رمز NF هو (٢).
  - تكون NF قوية إذا كانت قيمتها أكبر من (٢) ومن ثم فإن رمز NF هو (٣).
  - تكون AWS ضعيفة إذا كانت قيمتها أقل من (٢) ومن ثم فإن رمز AWS هو (٣).
  - تكون AWS متوسطة إذا كانت قيمتها محصورة بين (٢ و ٥) من ثم فإن رمز AWS هو (٢).
  - تكون AWS قوية إذا كانت قيمتها أكبر من (٥) ومن ثم فإن رمز AWS هو (١).
- الإستراتيجية المتبعة بخصوص قيمة معامل الصقل تقضى بالبحث عن التقاطع بين السطر والعمود:

- فإذا كانت NF ضعيفة وAWS قوية فنكون بصدد انقطاع فى مركبة الاتجاه العام ومن ثم يجب زيادة معامل الصقل بشكل كبير.
- وإذا كانت NF كبيرة وAWS متوسطة فإننا نكون بصدد احتمال وجود قيمة غير طبيعية ومن ثم لابد من تخفيض كبير فى قيمة معامل الصقل.
- وهكذا ....

قيمة معامل الصقل الموافقة لهذه الإستراتيجية نجدها فى التقاطع الحاصل بين قيم المؤشرين NF وAWS. وبطريقة عملية وبهدف إمكانية التحكم فى مسار معامل الصقل، يمكن حساب مجموع الرمزتين NF وAWS:

$$SOMME = CODE NF + CODE AWS$$

(١) أى مأخوذة من التجارب الخاصة بالمنشآت.

ومن ثم فإن قيمة معامل الصقل تستخلص مباشرة من المجموع السابق ومن خلال العلاقة التالية:

$$\alpha_i = 0.7 - 0.1 \times \text{SOMME}$$

الجدول رقم (٥) جدول القرار تبعاً لقيم NF وAWS

NF <sub>i</sub>	AWS <sub>i</sub>	ضعيف قيمة المعيار > ١,٥ CODE = ١	متوسط قيمة المعيار بين [١,٥ - ٣] CODE = ٢	قوى قيمة المعيار < ٣ CODE = ٣
		ضعيف قيمة المعيار > ٣ CODE = ٣	متوسط قيمة المعيار بين [٣ - ٥] CODE = ٢	قوى قيمة المعيار < ٥ CODE = ١
ضعيف قيمة المعيار > ٣ CODE = ٣	ضعيف قيمة المعيار > ٣ CODE = ٣	ضعيف قيمة المعيار > ٣ CODE = ٣	متوسطة قيمة شاذة	ضعيفة جداً ووجود قيمة شاذة
متوسط قيمة المعيار بين [٣ - ٥] CODE = ٢	متوسط قيمة المعيار بين [٣ - ٥] CODE = ٢	قوة واحتمال وجود انقطاع في الاتجاه العام	متوسطة قيمة شاذة	ضعيفة واحتمال وجود قيمة شاذة
قوى قيمة المعيار < ٥ CODE = ١	قوى قيمة المعيار < ٥ CODE = ١	قوة جداً وهناك انقطاع في الاتجاه العام	قوة واحتمال وجود انقطاع في الاتجاه العام	متوسطة، انقطاع في الاتجاه العام أو قيمة شاذة

يبين الجدول رقم (٦) القيمة المستخلصة لمعامل الصقل بدلالة القيم المختلفة لمجموع الرمز NF وAWS:

الجدول رقم (٦) قيم معامل الصقل الممثلة لمجموع الرمز NF وAWS

المجموع	$\alpha$
٦	٠,١
٥	٠,٢
٤	٠,٣
٣	٠,٤
٢	٠,٥

فى حالة نموذج Holt أو نموذج Holt-Winter علينا الاختيار لاثين أو ثلاثة معاملات للصقل ولإجراء ذلك نتبع الطريقة التالية:

- بالنسبة لمعامل صقل المتوسط  $\alpha$  فيمكن اتباع الطريقة السابقة.
- أما معامل صقل مركبة الاتجاه العام  $\beta$  الذى يفترض أن يكون أقل من السابق فيحسب من خلال العلاقة التالية:  $\beta_t = \alpha_t - 0.05$ .
- وأخيراً بالنسبة لمعامل صقل المركبة الفصلية  $\gamma$ ، فإنه فى حالة نموذج Holt-Winter يبقى ثابتاً ومساوياً للقيمة (٠.٢) وذلك لأن الانقطاعات فى مركبة الاتجاه العام والقيم الشاذة لا تؤثر فى المركبة الفصلية.

يمكن على سبيل المثال العودة للملف C3EX6.XLS لاختيار معامل الصقل فى نموذج الصقل الأسى المضاعف.

تتميز طرائق الصقل الأسى ببساطتها وسهولة تنفيذها ولكن بالمقابل فإن هذه الطريقة لا تأخذ بعين الاعتبار متغيرات البيئة الخارجية ولا تفترض لتلك المتغيرات أى تأثير فى التنبؤ. رغم أنه فى بعض الحالات يمكن إدخال عناصر تفسيرية خارجية تساعد فى تحسين التنبؤ المحصول عليه (انظر الفصل السابع). باختصار يمكننا عرض المزايا والسلبيات لهذه الطريقة بالجدول رقم (٧) التالى:

الجدول رقم (٧) نقاط الضعف والقوة فى طريقة الصقل الأسى

المزايا	السلبيات
- بساطة الحساب لإجراء التنبؤات.	- تعتمد على التمديد الخارجى وتتجاهل المتغيرات الخارجية.
- نظام يمكن اعتماده بعمليات تكرارية سهلة على Excel.	- اختيار صعب لمعامل الصقل.
- سرعة الحساب.	- ردة الفعل للنظام تكون متأخرة.
- إتقان آلية العمل من قبل المستخدم.	

## الفصل الرابع

### الطرائق الأساسية للتنبؤ (٢)

#### طرائق بوكس - جانكينز BOX- JENKINS والنماذج السببية

سندرس فى هذا الفصل طريقتين للتنبؤ هما:

- طريقة بوكس جانكينز التى تستند إلى عملية تمديد خارجى Extrapolation للظاهرة المدروسة من خلال العلاقة أو القانون الذى يحكم تلك الظاهرة، وفى هذه الحالة تكون البيانات اللازمة لهذه الطريقة محتواة فى السلسلة الزمنية نفسها دون اللجوء إلى معلومات خارجية ومن هنا تسمى هذه الطريقة طريقة التنبؤ الداخلى.
- الطريقة الثانية فى التنبؤ تعتمد على النماذج السببية أو التفسيرية التى تكون الغاية منها البحث عن تفسير التقلبات فى سلسلة المبيعات بالاستناد إلى عوامل تفسيرية خارجية متعلقة بالسياسات التسويقية للمنشأة أو بالطلب على السلعة نفسها.

#### ١- الارتباط البسيط والتمثيل البيانى لتابع الارتباط الذاتى:

فى البداية لا بد من توضيح مفهومى الارتباط البسيط  $corrélation$  والتمثيل البيانى لتابع الارتباط الذاتى  $corrélogramme$ .

##### ١-١- الارتباط البسيط:

عندما يكون لسلسلتين زمنيتين تحرك مشترك نقول إنهما مرتبطتان والارتباط البسيط يقيس شدة العلاقة الموجودة بين الظاهرتين الممثلتين بالمتغيرين  $x$  و  $y$ . يمكننا التمييز بين الارتباط الخطى وذلك عندما تكون أزواج القيم  $(x, y)$  موزعة بشكل قريب حول خط مستقيم، وبين الارتباط غير الخطى حيث تتوزع تلك القيم بشكل غير منتظم وبمسافات متغيرة حول ذلك المستقيم.

يمكن للارتباط بين متغيرين أن يكون:

- إيجابياً، حيث الزيادة (أو النقصان) فى قيم أحد المتغيرين تصاحبها زيادة (أو نقصان) فى قيم المتغير الثانى.

- سلبياً، وذلك عندما يُصاحب الزيادة في قيم أحد المتغيرين نقصان في قيم المتغير الآخر.
- بدون ارتباط في حال عدم وجود علاقة بين تغيرات قيم أحد المتغيرين وقيم المتغير الآخر.

#### ١-١-١-١ قياس معامل الارتباط الخطي:

يمكننا من خلال التمثيل البياني للظاهرتين المدروستين استيضاح وجود علاقة بينهما، ولكننا لا نستطيع قياس حدتها ومن أجل ذلك فإننا نستخدم مقياساً يسمى معامل الارتباط البسيط بين المتغيرين ونرمز له بالرمز  $\rho_{xy}$  وهو يساوى:

$$\rho_{xy} = \frac{Cov(x, y)}{\sigma_x \sigma_y} = \frac{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})}{\sqrt{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2} \sqrt{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2}}$$

$$\rho_{xy} = \frac{n \sum_{i=1}^n x_i y_i - \sum_{i=1}^n x_i \sum_{i=1}^n y_i}{\sqrt{n \sum_{i=1}^n x_i^2 - \left( \sum_{i=1}^n x_i \right)^2} \sqrt{n \sum_{i=1}^n y_i^2 - \left( \sum_{i=1}^n y_i \right)^2}}$$

مع اعتبار:

$x_i$  و  $y_i$  = تمثّلان قيم السلسلتين الزمنيتين في اللحظة  $i$ :

$Cov(x, y)$  = التباين المشترك بين  $x$  و  $y$ :

$\sigma_x$  و  $\sigma_y$  = الانحراف المعياري للمتغيرين  $x$  و  $y$  على الترتيب:

$\bar{x}$  و  $\bar{y}$  = المتوسطات الحسابية للمتغيرين  $x$  و  $y$  على الترتيب:

$n$  = عدد المشاهدات.

يمكن البرهان على أن قيمة معامل الارتباط محصورة بين -١ و +١ وتكون:

- قريبة من +١ في حالة الارتباط الإيجابي للمتغيرات.

- قريبة من -١ في حالة الارتباط السلبي للمتغيرات.

- قريبة من الصفر عندما لا يكون هناك ارتباط بين المتغيرات.

عملياً، نادراً ما تكون قيمة معامل الارتباط قريبة جداً من الحدود المذكورة سابقاً ومن ثم فمن الصعب إعطاء تفسير فعال لها من خلال القراءة البسيطة لقيمتها ولذلك

فإننا نلجأ إلى نظرية الاختبارات الإحصائية لتجنب هذه المسألة حيث نقوم بحساب نسبة تسمى بالقيمة التجريبية لإحصاء ستيودنت ونرمز لها بالرمز  $t$ :

$$t_{cal} = \frac{|\rho_{x,y}|}{\sqrt{\frac{(1-\rho_{x,y}^2)}{n-2}}}$$

فإذا كانت  $t_{cal} > t_{lu}$  حيث  $t_{lu}$  القيمة المقروءة من جدول توزيع ستيودنت عند  $n-2$  درجة حرية (في حال كان عدد المشاهدات أكبر من ٣٠ فإنه يمكننا اعتبار القيمة  $t_{lu} = 2$ )، فإن معامل الارتباط يكون مختلفاً معنوياً عن القيمة صفر أي ذو دلالة إحصائية وفي الحالة المعاكسة تكون فرضية كون معامل الارتباط معدوماً مقبولة.

ماذا يعنى القول مختلف معنوياً عن القيمة صفر؟

نقوم عادة بتحديد خطر الوقوع في الخطأ عبر تأكيدنا أن معامل الارتباط (الحقيقي والمجهول) مختلف عن القيمة صفر، وهذا الخطر يكون مقبولاً في حدود (٥٪) (إمكانية الخطأ في ٥٪ من الحالات) ولكن كلما كانت درجة الخطر المحددة ضعيفة: كان يقيننا مؤكداً بوجود الارتباط بين المتغيرين.

تكون العلاقة بين المتغيرين عموماً معنوية إذا كان خطر الوقوع في خطأ تأكيد أن معامل الارتباط مختلف عن الصفر أقل من (٥٪).

نعرض في الجدول رقم (١) مثلاً كيفية حساب معامل الارتباط بين المبيعات الفصلية لمنتج ما ( $x_i$ ) وبين مبالغ الإنفاق الفصلية على الدعاية والإعلان ( $y_i$ ).

الجدول رقم (١) مثال لحساب معامل الارتباط (الملف C4EX1.XLS)

الفصل	$x$	$y$	$x^2$	$y^2$	$x y$
١	١٦	٢٠	٢٥٦	٤٠٠	٣٢٠
٢	١٨	٢٤	٣٢٤	٥٧٦	٤٣٢
٣	٢٣	٢٨	٥٢٩	٧٨٤	٦٤٤
٤	٢٤	٢٢	٥٧٦	٤٨٤	٥٢٨
٥	٢٦	٣٢	٦٧٦	١٠٢٤	٨٣٢
٦	٢٨	٣٢	٧٨٤	١٠٢٤	٨٩٦



تابع - الجدول رقم (١).

الفصل	x	y	x <sup>2</sup>	y <sup>2</sup>	x.y
٧	٢٩	٢٨	٨٤١	٧٨٤	٨١٢
٨	٣١	٣٦	٩٦١	١٢٩٦	١١١٦
٩	٣٢	٤١	١٠٢٤	١٦٨١	١٣١٢
١٠	٣٤	٤١	١١٥٦	١٦٨١	١٣٩٤
المجموع	٢٦١	٣٠٤	٧١٢٧	٩٧٣٤	٨٢٨٦

$$\rho_{x,y} = \frac{(10)(8286) - (261)(304)}{\sqrt{(10)(7127) - 261^2} \sqrt{(10)(9734) - 304^2}} = 0.89$$

$$t_{cal} = \frac{0.89}{\sqrt{\frac{1-0.89^2}{10-2}}} = 5.49 > t_{lu} = 2.306$$

نحسب مؤشر اختبار ستودنت:

(حيث ٢,٣٠٦ تمثل القيمة الجدولية عند ٨ درجات حرية ومستوى دلالة ٥٪) ونخلص من ذلك إلى أن معامل الارتباط مختلف معنوياً عن القيمة صفر.

#### ١-١-٢- محدودية مفهوم الارتباط:

##### ١- الارتباط لا يعنى السببية:

إن وجود معامل ارتباط مرتفع بين متغيرين لا يعنى وجود أية علاقة أخرى غير العلاقة الإحصائية. بمعنى آخر، وجود تباين مشترك مختلف معنوياً عن الصفر لا يقود إلى وجود علاقة اقتصادية أو فيزيائية أو غيرها. نسمى هذا النوع من الارتباط بالارتباط الدخيل الذى لا يمكن أن يفسر شيئاً.

المثال الأكثر شيوعاً لهذا الموضوع هو ظاهرة وجود الارتباط القوي بين عدد البقع الشمسية المشاهدة وبين معدل الجريمة في الولايات المتحدة. وهذا بالطبع لا يعنى وجود علاقة بين هذين المتغيرين ولكن متغيراً ثالثاً وهو التطور الزمنى يشرح التحرك المشترك بين هاتين الظاهرتين.

ب - خطية العلاقة المختبرة:

لا يمكننا استخدام علاقات الحساب السابقة إلا من أجل اختبار الارتباط الخطي بين المتغيرات. فمعامل الارتباط المعدوم يشير إلى أن التباين المشترك بين المتغير  $x$  والمتغير  $y$  يساوى الصفر. وهذه النتيجة، أى معامل ارتباط معدوم، يمكن أن تتحقق أيضاً بالنسبة لمتغيرين مرتبطين بشكل كامل كما يبين المثال التالى. من المعروف أن معادلة الدائرة تعطى بالعلاقة  $x^2 + y^2 = R^2$  ومن الواضح أن المتغيرين  $x$  و  $y$  مرتبطان تابعياً فيما بينهما، فى حين أن تباينهم المشترك معدوم ومن ثم ينعدم معامل الارتباط بينهما أيضاً.

لتجنب هذه المسألة، من المناسب إجراء تحويل على المتغيرات بشكل مسبق لحساب معامل الارتباط وذلك بهدف جعل العلاقة بين المتغيرين خطية ويعتبر التحويل اللوغاريتمى من الوسائل الشائعة الاستخدام فى تحويل المتغيرات.

٢-١- تابع الارتباط الذاتى وتمثيله البيانى:

يرتبط مفهوم الارتباط الذاتى بمفهوم الارتباط البسيط وهو لا يعنى الارتباط بين متغيرين اثنين إنما بين قيم السلسلة الزمنية الواحدة بفواصل زمنية محددة.

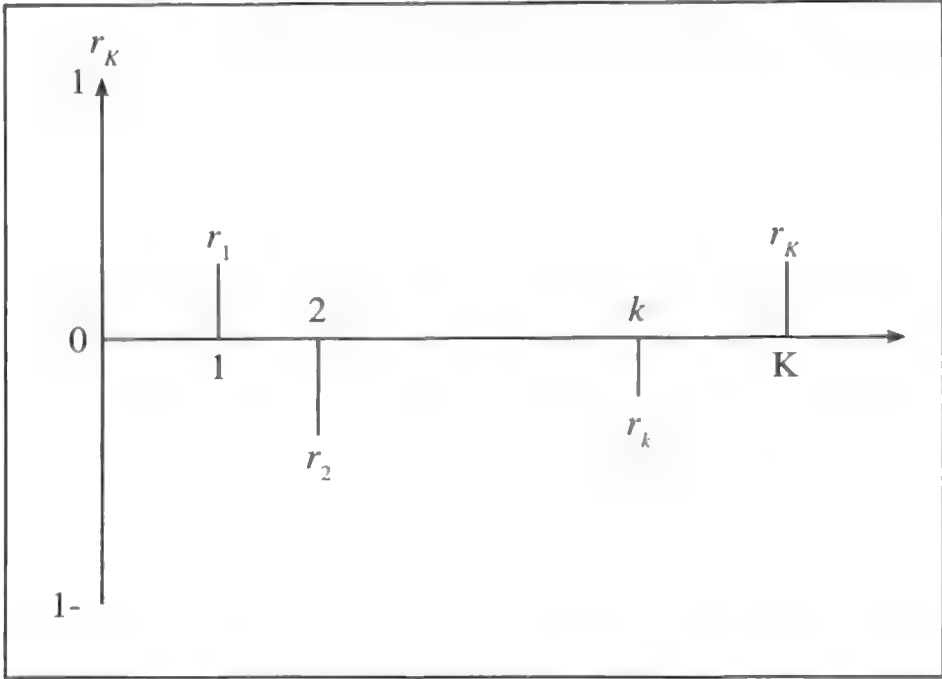
نسمى معامل ارتباط ذاتى من الدرجة ١، معامل الارتباط البسيط بين السلسلة الزمنية وبين السلسلة الزمنية المؤخرة فترة زمنية واحدة. يتم حساب معامل الارتباط الذاتى لعدة درجات من (٠) إلى (K) حيث تمثل هذه الأخيرة التأخير الزمنى الأعظمى الممكن (بشكل عام  $\frac{n}{3} \leq K \leq \frac{n}{6}$  أو  $K = \frac{n}{5}$  فى حال  $n \geq 50$ ) وذلك لكى يكون لهذا المعامل معنى (الجدول ٢).

الجدول رقم (٢) مثال لحساب الارتباط الذاتى

الارتباط الذاتى	التأخير الزمنى		
$r_0 = 1$	0	..... n	1,2,3,.....,t
$r_1$	1	n - 1	1,2,3,.....,t - 1
$r_2$	2	n - 2	1,2,3,.....,t - 2
.....	.....	.....	
$r_k$	k	n - k	t - k
.....	.....	.....	
$r_K$	K	n - K	t - K

يسمى التمثيل البياني لتابع الارتباط الذاتي (المشار إليه بالرمز FAC) بـ *Corrélogramme* وهو موضح بالرسم البياني رقم (١).

الشكل البياني رقم (١) مثال لـ *Corrélogramme*



يعطى معامل الارتباط الذاتي من الدرجة  $k$  بالعلاقة التالية:

$$r_k = \frac{\sum_{t=k+1}^n (x_t - \bar{x}_1) (x_{t-k} - \bar{x}_2)}{\sqrt{\sum_{t=k+1}^n (x_t - \bar{x}_1)^2 \sum_{t=k+1}^n (x_{t-k} - \bar{x}_2)^2}}$$

$$= \frac{\sum_{t=k+1}^n x_t x_{t-k} - (n-k) \bar{x}_1 \bar{x}_2}{\sqrt{\left( \sum_{t=k+1}^n x_t^2 - (n-k) \bar{x}_1^2 \right) \left( \sum_{t=k+1}^n x_{t-k}^2 - (n-k) \bar{x}_2^2 \right)}}$$

$$\bar{x}_1 = \frac{1}{(n-k)} \sum_{t=k+1}^n x_t \quad \bar{x}_2 = \frac{1}{(n-k)} \sum_{t=k+1}^n x_{t-k}$$

يسمح اختبار المعنوية لمعامل الارتباط الذاتى بانتقاء معاملات الارتباط المختلفة معنوياً عن القيمة صفر ويتم هذا الاختبار بشكل مشابه لاختبار المعنوية لمعامل الارتباط البسيط حيث يتم حساب المؤشر  $r_k = \frac{|r_k|}{\sqrt{1-r_k^2}} \sqrt{n-2}$  فإذا كان  $r_k > r_{n-2}^{a/2}$  يكون معامل الارتباط الذاتى مختلفاً معنوياً عن القيمة صفر.

يسمح حساب  $r_k$  بالكشف عن العلاقات الداخلية فى السلسلة الزمنية، فعلى سبيل المثال يكون لسلسلة زمنية فصلية وقبل حذف المركبة الفصلية منها قيمة مرتفعة لمعامل الارتباط الذاتى من الدرجة ١٢ أى  $r_{12}$  ومن خلال معرفة القيم لتابع الارتباط الذاتى يمكن الكشف عن السياق الداخلى المولد لهذه السلسلة. وهكذا فإن حساب معاملات الارتباط الذاتية تعتبر عملية ضرورية ومسبقة لعملية تحديد النموذج الرياضى لجميع الطرائق الداخلية.

هناك خاصتان يجب الإشارة إليهما فيما يتعلق بقيمة معامل الارتباط الذاتى:

- $r_n = 1$  (ارتباط تام لحدود السلسلة فيما بينها عند التأخير الزمنى الصفرى).
- $r_k = r_{-k}$  (تكون قيم الـ *Corrélogramme* متطابقة لتأخيرين زمنيين متناظرين بالنسبة للفترة الأساس).

نسمى التمثيل البيانى لتابع الارتباط الذاتى بـ *Corrélogramme* ومن المفضل أن نمثل على هذا الرسم البيانى مجال الثقة حول القيمة صفر ( $\pm 2/\sqrt{n}$ ) مما يسمح بحذف كل الحدود غير المختلفة معنوياً عن القيمة صفر.

وهكذا فإنه فى حالة كون جميع قيم معاملات الارتباط الذاتى متوضعة ضمن مجال الثقة، فإن مسار السلسلة يكون عشوائياً بشكل كامل أى يكون من المستحيل إيجاد قانون احتمالى إحصائى يشرح السياق المولد لهذه الظاهرة. نفصل فى الجدول (٢) التالى عمليات الحساب لمعامل الارتباط الذاتى من الدرجة ٢ أى الارتباط بين  $x_t$  و  $x_{t-2}$  وذلك للمعطيات المتعلقة بالمبيعات الفصلية.

الجدول رقم (٣) مثال لحساب معامل الارتباط الذاتي من الدرجة ٢

$(x_{t-2} - \bar{x}_2)^2$	$(x_t - \bar{x}_1)^2$	$(x_t - \bar{x}_1)(x_{t-2} - \bar{x}_2)$	$x_{t-2}$	$x_t$	$t$
٨٨٥١٨,١٥	٤٣١١٦٢,٩٩	١٩٥٣٦٠,٥٦	١٢٤٨	١٠٥٧	١
٢٣٦٢٩,٨٤	٢٠٩٠٥٤٠,٤٧	٢٢٢٢٥٩,١٧-	١٣٩٢	٣١٥٩	٢
٢٣٩٣٣٦,٢٣	٦٧٦٣٩١,١٥	٤٠٢٣٤٩,٢٤	١٠٥٧	٨٩١	٣
٢٦٠٢٦٧٢,٨٢	٤١٩٩١٣,٢٨	١٠٤٥٢٩٢,٦٠-	٣١٥٩	١٠٦٥	٤
٤٢٩٠٥١,٢٤	٣٥٤٧٧٥,٠٥	٣٩٠١٤٩,٥٦	٨٩١	١١١٨	٥
٢٣٠٠٨٩٩,٤٧	١٤٩٠٧٦٧,٥٩	٥٨٦٧٠٠,٤٧-	١٠٦٥	٢٩٣٤	٦
١٨٣٣٧٢,٣٤	٣٣٠٦٥٩,٥٧	٢٤٦٢٣٩,٣٥	١١١٨	١١٣٨	٧
١٩٢٧٥٩٨,٨٤	٦٦١٦٧,٢٦	٢٥٧١٣٢,٩٥-	٢٩٣٤	١٤٥٦	٨
١٦٦١٥٤,١٢	٢٣٩٠٥٢,٥٣	١٩٩٢٩٧,٦٧	١١٣٨	١٢٢٤	٩
٨٠٦٧,٦٣	١٨٩٦٠٤٦,٢٧	١٢٣٦٧٩,٤٢	١٤٥٦	٣٠٩٠	١٠
٥٨٩٩٣٠٠,٦٨	٧٩٩٥٣٧٦,١٧	٩٠١٦٦٨,٢٣-	١٤٤٥٨,٢٠	١٧١٣٢,٣٠	المجموع

من الجدول السابق نجد:

$$\bar{x}_1 = 1713.2$$

$$\bar{x}_2 = 1545.8$$

$$r_2 = \frac{\sum_{t=k+1}^n (x_t - \bar{x}_1)(x_{t-2} - \bar{x}_2)}{\sqrt{\sum_{t=k+1}^n (x_t - \bar{x}_1)^2 \sum_{t=k+1}^n (x_{t-2} - \bar{x}_2)^2}}$$

$$= \frac{-901668.23}{\sqrt{5899300.68} \sqrt{7995376.17}} = -0.13$$

ومن أجل  $n = 10$  و  $r_2 = -0.13$  تكون قيمة  $t_c$  مساوية لـ:  $t_c = \frac{|r_k|}{\sqrt{1-r_k^2}} \sqrt{n-2} = 0.38$

وبالمقارنة مع القيمة الجدولية نجد  $t_{10-2}^{0.05/2} < t_c$ . إذن يعتبر معامل الارتباط الذاتى غير مختلف معنوياً عن القيمة صفر.

يشير الجدول رقم (٤) إلى مجموعة القيم لتابع الارتباط الذاتى التى نقارنها مع القيمة المقروءة فى جدول توزيع ستيودنت من أجل مستوى دلالة (٥٪) وعند  $n$  - درجة حرية. نلاحظ أن قيمة معامل الارتباط الذاتى من الدرجة ٤ هى القيمة الوحيدة المختلفة معنوياً عن القيمة صفر، وذلك لأن المعطيات فصلية ومن ثم فإن البروز الملاحظ يعود للمركبة الفصلية للمعطيات.

الجدول رقم (٤) حساب تابع الارتباط الذاتى

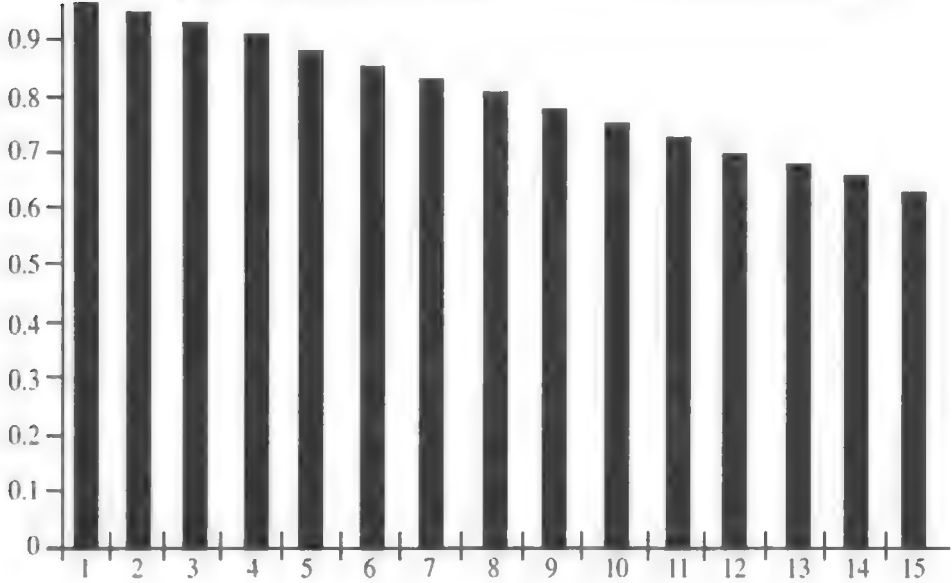
القيمة الجدولية	درجات الحرية	$t_c$	$n$	$r_k$	
-	-	-	١٢	١	٠
٢,٢٦٢	٩	١,٢٩	١١	٠,٣٩٥-	١
٢,٣٠٦	٨	٠,٣٨	١٠	٠,١٢٢-	٢
٢,٣٦٥	٧	١,١٣	٩	٠,٣٩٢-	٣
٢,٤٤٧	٦	٧,٦٢	٨	٠,٩٥٢	٤

فى الطرائق المسماة داخلية، عادة ما يتم تقسيم السلسلة الزمنية إلى مكوناتها الأساسية الثلاثة: مركبة الاتجاه العام أو النزعة والمركبة الفصلية ثم مركبة البواقي وذلك كمرحلة أولى ثم تأتى مرحلة التمديد الخارجى لكل مركبة بشكل منفصل وأخيراً إعادة تجميع هذه المركبات للحصول على التنبؤات المطلوبة.

فيما يتعلق بالتمديد الخارجى لمركبتى الاتجاه العام والفصلية فإن ذلك لا يفرض أية مشاكل أما فيما يتعلق بالتمديد الخارجى لمركبة البواقي فهناك عدة وسائل مختلفة لهذه الغاية وتستند جميعها إلى الدراسة المسبقة لتمثيل البيانات للارتباط الذاتى *Corrélogramme*.

فى حال معالجة السلسلة المخلصة من التأثير الفصلى (أى التى تحتوى على مركبتى النزعة والبواقي فقط) بدلاً من معالجة مركبة البواقي، فإن الشكل العام

لا  $\text{Corrélogramme}$  مشابه لسياق غير مستقر (أى أن متوسط السلسلة غير ثابت ويتحرك مع الزمن، وذلك لأن مركبة الاتجاه العام ما زالت موجودة فى السلسلة، انظر الشكل البياني ٢) ومن ثم لا نستطيع الحصول على أية معلومات يمكن الاستفادة منها. لهذا السبب يكون ضرورياً إجراء الحسابات لتابع الارتباط الذاتى على السلسلة دون مركبتى الاتجاه العام والمركبة الفصلية.

الشكل البياني رقم (٢) الـ  $\text{Corrélogramme}$  لسلسلة زمنية غير مستقرة (ذات نزعة)

وكما ذكرنا سابقاً من الممكن عدم وجود أى حد من حدود  $\text{Corrélogramme}$  مختلف معنوياً عن القيمة صفر، وهذا من ثم يعنى أن السياق المولد للظاهرة هو سياق عشوائى بشكل خالص أى لا يمكن التنبؤ به. نخلص من ذلك إلى أن التنبؤ لا يمكن الحصول عليه إلا من خلال التمديد الخارجى لمركبة الاتجاه العام أو من خلال الصقل الآسى. بالمقابل اقترح بوكس وجانكينز طريقة أخرى لإجراء التنبؤ تستند إلى تحديد السياق التحتى المولد للظاهرة المثلة بالسلسلة الزمنية للمبيعات.

### ٣-١- مقدمة فى طريقة بوكس وجانكينز:

فى حال كانت الحدود الأولى من الـ  $\text{Corrélogramme}$  مختلفة معنوياً عن القيمة صفر، يمكننا عندئذ إيجاد نموذج رياضى للبواقي أى إيجاد القانون المولد للظاهرة

المدرسة. هناك العديد من النماذج الرياضية الداخلية المتفاوتة الصعوبة<sup>(١)</sup> وسنعرض هنا فقط النماذج المعروضة في طريقة بوكس وجانكينز وهي تتميز باستخدامات مهمة في مجال التنبؤ.

لقد طور بوكس وجانكينز<sup>(٢)</sup> طريقة حقيقية للبحث المنتظم عن النموذج المناسب المثل للظاهرة باستخدام التمثيل البياني لتوابع الارتباط الذاتي أي لا *Corrélogramme*. ولقد استندا إلى نمطين من النماذج الرياضية، نماذج الوسط المتحرك *MA* ونماذج الانحدار الذاتي *AR* أو إلى توفيق مشترك لكليهما.

#### ١-٣-١ - دراسة النماذج:

تسمح النماذج المسماة بنماذج *ARMA* بتمثيل معظم السياقات العشوائية المستقرة (Wold, ١٩٥٤) ومن ثم تغطي فئة واسعة جداً من مسارات السلاسل الزمنية، ويمكننا تمييز نمطين من هذه النماذج: نماذج الانحدار الذاتي *AR* ونماذج الوسط المتحرك *MA* وكل من هذه النماذج يتميز بتابع ارتباطه الذاتي البسيط (*FAC*) وتابع ارتباطه الذاتي الجزئي (*FAP*).

إن مفهوم تابع الارتباط الذاتي الجزئي *FAP* أكثر تعقيداً من مفهوم تابع الارتباط الذاتي البسيط *FAC* وهو يمثل الارتباط بين  $x_t$  و  $x_{t-k}$  مع عزل تأثير المتغيرات  $x_{t-k-i}$  حيث ( $i < k$ ).

#### - نماذج الانحدار الذاتي (*Auto Regressive (AR)*):

يتكون الجزء الخاص بالانحدار الذاتي لسياق ما والمشار إليه بالرمز *AR* من توفيق خطى منتهى للقيم السابقة للسياق. ويُعرف السياق  $AR(p)$  انطلاقاً من العلاقة العامة التالية:

$$x_t = \phi_1 x_{t-1} + \dots + \phi_p x_{t-p} + a_t$$

حيث يمثل  $a_t$  سياق ضجة بيضاء غوصى. ويكون لدينا على سبيل المثال:

$$AR(1) : x_t = \phi_1 x_{t-1} + a_t$$

$$AR(2) : x_t = \phi_1 x_{t-1} + \phi_2 x_{t-2} + a_t$$

(١) سوف يقتصر العرض في هذا الكتاب على النماذج البسيطة ويمكن للقارئ العودة إلى Bourbonnais et Terraza (١٩٩٨) لمزيد من النماذج.

(٢) Box et Jenkins (١٩٧٦).



يتميز السياق  $AR(p)$  بالخصائص التالية:

- لتابع ارتباطه الذاتي البسيط FAC شكلاً آسياً و/أو شكلاً جيبيياً متخامداً.
- الحدود الـ  $p$  الأولى من تابع ارتباطه الذاتي الجزئي FAP تكون الوحيدة المختلفة معنوياً عن القيمة صفر.

- نماذج الوسط المتحرك (Moving Average (MA):

يتكون الجزء الخاص بالوسط المتحرك لسياق ما المشار إليه بالرمز MA من توفيق خطى منتهى للقيم السابقة لسياق ضجة بيضاء. ويُعرف السياق  $MR(q)$  انطلاقاً من العلاقة العامة التالية:

$$x_t = a_t - \theta_1 a_{t-1} - \dots - \theta_q a_{t-q}$$

حيث  $a_t$  تمثل سياق ضجة بيضاء غوصى. ويكون لدينا على سبيل المثال:

$$MA(1) : x_t = a_t - \theta_1 a_{t-1}$$

$$MA(2) : x_t = a_t - \theta_1 a_{t-1} - \theta_2 a_{t-2}$$

ويتميز السياق  $MR(q)$  بالخصائص التالية:

- الحدود الـ  $q$  الأولى من تابع ارتباطه الذاتي البسيط FAC تكون الوحيدة المختلفة معنوياً عن القيمة صفر.

- لتابع ارتباطه الذاتي الجزئي FAP شكلاً آسياً و/أو شكلاً جيبيياً متخامداً.

يمكننا ملاحظة التشابه فى سلوكيات كل من تابع الارتباط الذاتي البسيط FAC لسياق الانحدار الذاتي وتابع الارتباط الذاتي الجزئي FAP لسياق المتوسط المتحرك وكذلك تابع الارتباط الذاتي البسيط FAP للوسط المتحرك مع تابع الارتباط الذاتي الجزئي FAC لسياق الانحدار الذاتي. ويمكننا البرهان على تحقق الخاصة التالية:  $MA(1) = AR(\infty)$  و  $AR(1) = MA(\infty)$ .

- نماذج الانحدار الذاتي والوسط المتحرك ARMA:

تمثل هذه النماذج خليطاً من نماذج الانحدار الذاتي ومن نماذج الوسط المتحرك ويمكن تعريفها انطلاقاً من العلاقة التالية:

$$ARMA(p,q) : x_t = \phi_1 x_{t-1} + \dots + \phi_p x_{t-p} + a_t - \theta_1 a_{t-1} - \dots - \theta_q a_{t-q}$$

وكمثال عليها نذكر:

$$ARMA(1,1) : x_t = \phi_1 x_{t-1} + a_t - \theta_1 a_{t-1}$$

$$ARMA(2,1) : x_t = \phi_1 x_{t-1} + \phi_2 x_{t-2} + a_t - \theta_1 a_{t-1}$$

نلاحظ أن  $ARMA(0,q) = MA(q)$  و  $ARMA(p,0) = AR(p)$ . يبين الجدول رقم (٥) الخصائص المميزة لهذه السياقات تبعاً للـ  $Corrélogramme$ .

- شروط الاستخدام:

يمكن استخدام النماذج  $AR$  و  $MA$  و  $ARMA$  لتمثيل السياقات:

- المستقرة بالمتوسط (أى دون مركبة اتجاه عام).

- المصححة من التقلبات الفصلية.

الجدول رقم (٥) ملخص لخصائص توابع الارتباط الذاتي البسيط والجزئى

السياق	FAC	FAP
$AR(1)$	أسى متناقص ( $\phi_1 > 0$ ) أو جيبي متخامد ( $\phi_1 < 0$ )	بروز معنوي عند التأخير الأول: موجب إذا ( $\phi_1 > 0$ ) وسالب إذا ( $\phi_1 < 0$ ) والمعاملات الأخرى معدومة للتأخيرات أكبر من الواحد.
$AR(2)$	أسى متناقص أو جيبي وفقاً لإشارة $\phi_1$ و $\phi_2$ .	بروزات معنوية للتأخير الأول والثاني والمعاملات الأخرى معدومة للتأخيرات أكبر من ٢.
$AR(p)$	أسى متناقص و/أو جيبي	بروزات معنوية للتأخيرات الـ $p$ الأولى والمعاملات الأخرى معدومة للتأخيرات أكبر من $p$ .
$MA(1)$	بروز معنوي عند التأخير الأول: موجب إذا ( $\theta_1 < 0$ ) وسالب إذا ( $\theta_1 > 0$ ) والمعاملات الأخرى معدومة للتأخيرات أكبر من الواحد.	أسى متناقص ( $\theta_1 > 0$ ) أو جيبي متخامد ( $\theta_1 < 0$ ).
$MA(2)$	بروزات معنوية للتأخير الأول والثاني والمعاملات الأخرى معدومة للتأخيرات أكبر من ٢.	أسى متناقص أو جيبي وفقاً لإشارة $\theta_1$ و $\theta_2$ .
$MA(q)$	بروزات معنوية للتأخيرات الـ $q$ الأولى والمعاملات الأخرى معدومة للتأخيرات أكبر من $q$ .	أسى متناقص و/أو جيبي.
$ARMA(1,1)$	هندسى متناقص اعتباراً من التأخير الأول والإشارة محددة بواسطة $\phi_1 - \theta_1$ .	أسى متناقص ( $\theta_1 > 0$ ) أو جيبي متخامد ( $\theta_1 < 0$ ).
$ARMA(p,q)$	أسى متناقص أو جيبي متخامد غير كامل بعد تأخيراً $(q - p)$ .	أسى متناقص أو جيبي متخامد غير كامل بعد تأخيراً $(p - q)$ .

## ١-٣-٢- السياقات المستقرة:

لا يمكننا تفسير التمثيل البياني لتابع الارتباط الذاتي أى ال  $Corrélogramme$  إلا إذا كانت السلسلة الزمنية مستقرة (أى دون مركبة اتجاه عام) ولمعرفة ذلك نلجأ إلى استخدام الاختبارات الإحصائية مثل اختبار  $Dickey-Fuller$  (١٩٧٩) واختبار  $Dickey-Fuller Augmented$  (١٩٨١) وفى حال تبين من الاختبارات الأخيرة أن السلسلة غير مستقرة يكون التساؤل حول نمط عدم الاستقرارية الموجود فى السلسلة. هناك نمطان، الأول يرمز له بالرمز  $Trend Stationary (TS)$  وهو يمثل عدم استقرارية من النمط الجبرى والثانى يرمز له بالرمز  $Differency Stationary (DS)$  ويتعلق بالسياقات غير المستقرة العشوائية. فإذا كانت السلسلة غير المستقرة من النمط  $TS$ ، فإنه يمكن جعلها مستقرة من خلال إجراء انحدار لها على الزمن، ومن ثم يصبح ممكناً دراسة بواقي التقدير باستخدام طريقة بوكس - جانكينز وهذا يسمح بتحديد الدرجات  $p$  و  $q$  للأجزاء  $AR$  و  $MA$  لبواقي التقدير. النموذج فى هذه الحالة هو دائماً نموذج  $ARMA(p,q)$ .

أما إذا كانت السلسلة غير مستقرة من النمط  $DS$ ، فإنه يجب جعلها مستقرة من خلال تحويلها بالتفاضل (أخذ الفروقات) وفقاً لدرجة تكامل محددة  $I = d$  (تمثل عدد مرات التفاضل الواجب إجراؤها لجعل السلسلة مستقرة). بعد ذلك ندرس السلسلة مأخوذة التفاضل وفقاً لطريقة بوكس وجانكينز مما يسمح بتحديد الدرجات  $p$  و  $q$  للأجزاء  $AR$  و  $MA$ . نشير لهذا النمط من النماذج بالرمز  $ARIMA(p,d,q)$ .

## ١-٣-٣- البحث عن التمثيل المناسب للمعطيات:

المقصود هنا هو البحث عن النموذج المناسب من بين النماذج  $(ARMA, MA, AR)$  وهو يبدو أكثر ملاءمة لبيانات السلسلة المدروسة وبعد ذلك تحديد عدد درجات النموذج المختار أى  $p$  أو  $q$  أو  $p$  و  $q$ .

## - التعريف بالنموذج:

تعتبر مرحلة التعريف بالنموذج المناسب من أهم المراحل وأصعبها وهى تعنى اختيار النموذج المناسب وتحديد درجاته. تستند الطريقة المتبعة من أجل ذلك إلى دراسة ال  $Corrélogramme$  أى الارتباط الذاتى البسيط والجزئى.

تعتبر هذه المرحلة فى طريقة بوكس وجانكينز أساسية ووفقاً لها تتحدد الخطوات اللاحقة.

- التقدير الإحصائي والتحقق من صلاحية النموذج:

يستند تقدير مؤشرات النموذج إلى جعل تابع الإمكانية العظمى فى حدوده العليا فى حين أن التحقق من النموذج يتم من خلال:

- معاملات النموذج التى يجب أن تكون مختلفة معنوياً عن القيمة صفر (يمكن هنا تطبيق اختبار ستيودنت العادى). وفى حال كانت إحدى المعاملات غير مختلفة عن القيمة صفر، فإنه يجب البحث عن نموذج آخر يأخذ بعين الاعتبار المعاملات للنموذج AR أو MA غير الصالحة.

- تحليل البواقي (أى الانحراف ما بين السلسلة المشاهدة والسلسلة المتنبأ بها) وهذا يسمح بالتحقق فيما إذا كانت البواقي:

- ذات متوسط معدوم وفى الحالة المعاكسة فإنه يجب إضافة ثابت للنموذج المقدر.

- ممثلة لسياق ضجة بيضاء، وفى حال ثبت أن البواقي لا تمثل سياق ضجة بيضاء فإن ذلك يعنى أن تعريف النموذج غير كامل وينقصه إضافة درجة على الأقل إلى السياق الأصلى.

تتميز مرحلة التحقق من صلاحية النموذج بأهميتها، وتستلزم فى كثير من الحالات العودة إلى مرحلة تعريف النموذج.

- التنبؤ:

بعد التحقق من صلاحية النموذج المختار يمكننا إجراء التنبؤ لمجال زمنى محدد وليكن  $h$  وهذا المجال يخضع فى طوله لتباين خطأ التنبؤ الذى يزداد كلما ازداد طول مجال التنبؤ.

يجب أن نشير هنا إلى أنه فى مرحلة جعل السلسلة مستقرة كنا قد أجرينا تحويلاً ما على معطيات السلسلة، ومن ثم فعند إجراء التنبؤ لهذه السلسلة لا بد من أخذ هذه التحويلات بعين الاعتبار وإجراء عملية معاكسة لها للحصول على تنبؤات معقولة.

- وفى حال استخدامنا للانحدار الخطى لعزل واحدة أو أكثر من مكونات السلسلة الزمنية المقدره بواسطة طريقة المربعات الصغرى العادية MCO فإننا نجرى عملية تمديد خارجى لهذه المركبات حتى المجال الزمنى المختار، ومن ثم نضيف هذه القيم إلى القيم المتنبأ بها بواسطة النموذج ARMA.

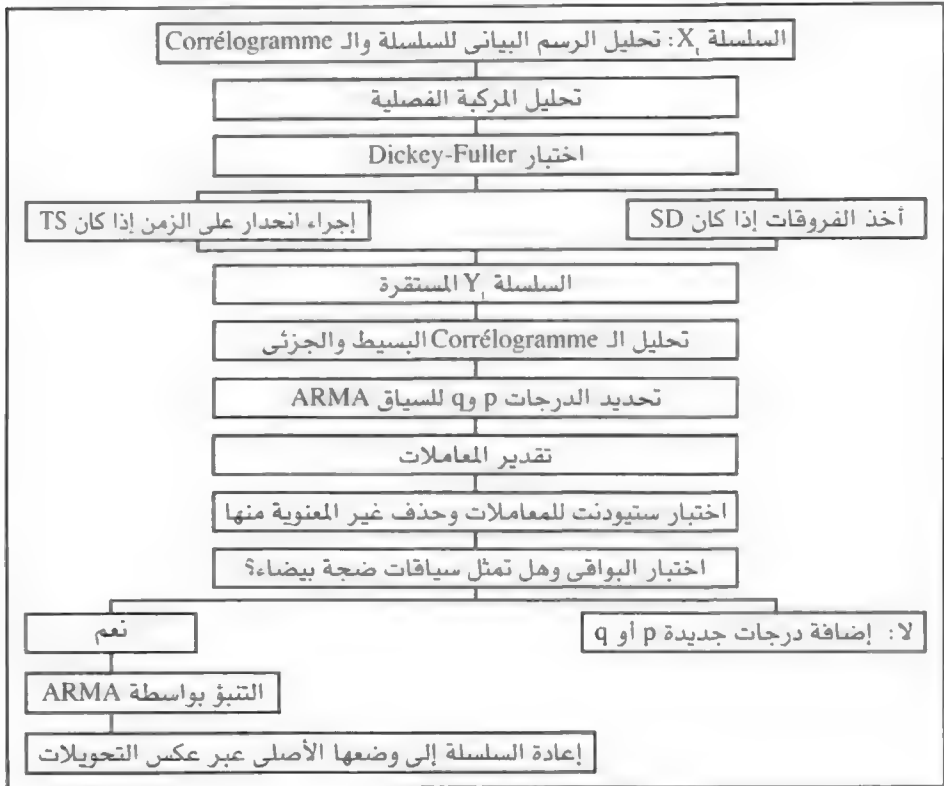
- أما إذا كنا قد حذفنا المركبة الفصلية بشكل مسبق، فإنه يجب علينا إعادة المركبة الفصلية لسلسلة المبيعات وذلك للحصول على تنبؤات خام.

يشار أخيراً إلى أن هذه النماذج من النمط ARIMA لاقت نجاحاً كبيراً وتفرّع عنها أنماط أخرى من النماذج بتسميات مختلفة مثل ARCIMA و ARFIMA و.... وتُستخدم في مجالات مالية محددة. كما يُبرهن على أن الصقل الآسى ليس إلا حالة خاصة من النموذج ARIMA.

يمثل الرسم التوضيحي رقم (١) آلية العمل في طريقة بوكس - جانكينز، وتعتبر عملية فحص الـ *Corrélogramme* المصدر المعلوماتي الوحيد بيد القائم على التنبؤ لمساعدته في اختيار النموذج الصحيح.

فإذا أوحى الـ *Corrélogramme* بنموذج محدد فإن ذلك يُسهل طريقة التنبؤ ولكن في معظم الحالات نواجه عدداً كبيراً من النماذج المرشحة ومن ثم لا بد من اختبار كل واحدة منها للوصول إلى النموذج الأنسب. هناك بعض الوسائل المستخدمة في هذا المجال وتشتمل على بعض المعايير لإجراء المقارنة بين النماذج المرشحة.

الرسم التوضيحي رقم (١) منهجية طريقة بوكس - جانكينز



من خلال العرض السابق نجد أن المستخدم لطريقة بوكس وجانكينز غالباً ما يجد نفسه ضائعاً بين النتائج وأمام عدد كبير من الخيارات مما يؤدي إلى فقدان الكثير من الجهد البشري والآلى للتحقق من كل حالة ومدى ملاءمتها للمعطيات المدروسة بهدف تحسين جودة التنبؤ. ومن ثم فإن هذه الطريقة تبدو صعبة في إدارتها من طريقة الصقل الأسى على الرغم من عدم اليقين من الوصول إلى جودة أفضل في التنبؤ، وهذا يُفسر ندرة استخدام هذه الطريقة لدى المنشأة وعدم اشتغالها في البرمجيات الجاهزة، ومن ثم اقتصار التعامل معها لدى الباحثين في المجالات الاقتصادية الجزئية كمعطيات الأسواق المالية (الأسهم، معدلات الفائدة، ...) التي تتميز بتردداتها الكبيرة (يوم أو حتى ساعة).

في هذه الطريقة الداخلية للتنبؤ أى الاعتماد على السلسلة نفسها من خلال تقنيات الصقل الأسى أو طريقة بوكس - جانكينز يتم إجراء معالجة متسلسلة لعدد كبير من السلاسل الزمنية ولكن في حالة المعالجة الآلية يكون التدخل البشري محدوداً.

لا يمكن استخدام هذه الطريقة في التنبؤ إلا من أجل السياقات الثابتة نسبياً وذات التأثير المحدود بالحالة الاقتصادية العامة أو بالسياسات التسويقية للمنشأة التجارية. وهناك بعض المنتجات في قطاع الاستهلاك الكبير لها هذه الخصائص ولكن بالمقابل فإن المنتجات الصناعية المرتبطة بشدة بالبيئة الاقتصادية التي تلعب فيها المنافسة دوراً مهماً لا يمكن معالجتها بهذه التقنية.

في إطار نظام إدارة المخزون يسمح نظام تحليل السلاسل الزمنية بمعالجة سريعة لعدد كبير من المنتجات، ويمكن أيضاً من خلاله إجراء تنبؤات مكلفة بعض الشيء ولكنها ذات دقة متناهية جداً.

ومن ثم فإنه يمكن من خلال البرنامج الآلى معالجة السلاسل الزمنية للمبيعات وإعطاء التنبؤ المطلوب عند المجال الزمني المرغوب والمحدد من قبل المستخدم الذي يمكن ألا يكون ملماً بإدارة النظام.

هذه الميزة للمستخدم تقابلها نقطة ضعف واضحة تتمثل في التغير المفاجئ بالوضع الاقتصادي (الانتقال من مرحلة النمو إلى مرحلة الركود الاقتصادي أو العكس) الذي لا يمكن التنبؤ به. بالإضافة إلى ذلك، لا يمكن الأخذ بعين الاعتبار بشكل فعال لتأثير الحالة الاقتصادية أو النفقات الدعائية على التنبؤات الناتجة.

لمحاولة تخطي هذه العقبات نستخدم الطرائق الخارجية التي تسمح بإجراء توقعات حول التقلبات في الحالة الاقتصادية (الانتقال من مرحلة النمو إلى مرحلة

الركود الاقتصادي أو العكس) وتجيز إدخال المتغيرات الأخرى المتوقع أن تؤثر في سلسلة المبيعات المراد التنبؤ بها.

## ٢- الطريقة الخارجية لإجراء التنبؤ:

يتلخص الإطار العام للطرائق الخارجية المستخدمة للتنبؤ في البحث عن سلاسل زمنية خارجية تفسر تقلبات السلسلة الزمنية المراد التنبؤ بها. سنعرض في هذا الجزء المفاهيم النظرية الأساسية<sup>(١)</sup> ثم نبحث في الجزء الثاني (الاستخدام في القطاعات) كيفية استثمار هذه التقنيات انطلاقاً من أمثلة تطبيقية لمعطيات تخص بعض القطاعات.

هناك العديد من المتغيرات الاقتصادية المرتبطة فيما بينها بعلاقة ما والمثال التقليدي الأكثر وضوحاً هو ذلك المتعلق بالعلاقة الموجودة بين الاستهلاك والدخل. ونحن هنا لن نستعرض أمثلة للعلاقة الموجودة بين المتغيرات الاقتصادية الكلية كون ذلك لا يشكل الهدف من هذا الكتاب، ولكن في المقابل يوجد ضمن قطاع النشاط التجاري للسوق أو للمنشأة علاقات يمكن أيضاً توضيحها. هناك الكثير من الأمثلة التي سنراها عند استعراضنا للفصول المتعلقة بالتطبيقات في القطاعات المختلفة. فالتقلبات في حركة المبيعات يمكن تفسيرها بتزايد الطلب على السكن، بمعدلات الفائدة، بالنفقات الدعائية، بالشروط المناخية، بعمليات الترويج للمبيعات، .... هذه المجموعة من المعطيات يتم متابعتها من قبل رجال المنشأة الاقتصادية ومن قبل القائمين على إجراء التنبؤ ومن قبل أصحاب المنتج.

الغاية مما سنعرضه الآن هي عرض الطرائق المتعلقة بالانحدار البسيط والمتعدد ونستطيع من خلالها:

- الحصول على تقدير كمي دقيق إلى حد ما عن العلاقة بين السلسلة التي نرغب في إجراء التنبؤ لها وبين السلاسل الأخرى التفسيرية.
- تحديد مقدار الدقة لهذا التقدير الكمي بهدف معرفة درجة الثقة التي يجب إعطاؤها للعناصر التفسيرية.

## ٢-١- مفهوم توفيق البيانات ونموذج الانحدار البسيط:

لقد رأينا سابقاً أن معامل الارتباط يدل على درجة العلاقة الموجودة بين سلسلتين

(١) يمكن للقارئ المهتم بطرائق الاقتصاد القياسي العودة إلى كتاب (Bourbonnais ٢٠٠٠).

زمنيتين، وعند التأكد من وجود هذه العلاقة فإننا نحسب مؤشراً كمياً يمثل شدة هذه العلاقة بين المتغيرين الاقتصاديين (المبيعات والعامل التفسيري لتقلب المبيعات على سبيل المثال).

يمكننا التعبير عن العلاقة بين هذين المتغيرين بواسطة العلاقة التالية:

$$V_t = a_1 x_t + a_0 + \varepsilon_t$$

حيث  $a_0$  و  $a_1$  تمثلان المعاملات المجهولة للعلاقة.

$V_t$  تمثل سلسلة المبيعات أو السلسلة الواجب تفسيرها.

$x_t$  تمثل المتغير أو السلسلة التفسيرية (المتغير الخارجى).

$\varepsilon_t$  هى الحد العشوائى الممثل للمتغيرات الأخرى ذات العلاقة بتقلبات المبيعات وغير المحتواة فى النموذج. وهى تمثل سياقاً غوصياً أى يحقق الفرضيات الأساسية: التوقع الرياضى للخطأ معدوم ( $E(\varepsilon_t) = 0$ )، التباين الثابت للخطأ ( $V(\varepsilon_t) = \sigma^2$ ) واستقلالية الأخطاء ( $E(\varepsilon_t \varepsilon_{t'}) = 0$ ) من أجل  $t \neq t'$ .

يتضمن المبدأ الأساسى لتوفيق البيانات بواسطة طريقة المربعات الصغرى (طريقة الانحدار) اختيار  $a_0$  و  $a_1$  كمقدرات للنموذج بحيث يكون مجموع مربعات الأخطاء بين القيم المصححة (المضبوطة) ( $\hat{y}_t$ ) بواسطة المتغير التفسيري  $x_t$  والمشاهدات الحقيقية  $y_t$  فى حدوده الدنيا، أى:

$$\text{Min} \left( \sum_{t=1}^n \varepsilon_t^2 \right) = \text{Min} \left( \sum_{t=1}^n (y_t - \hat{y}_t)^2 \right)$$

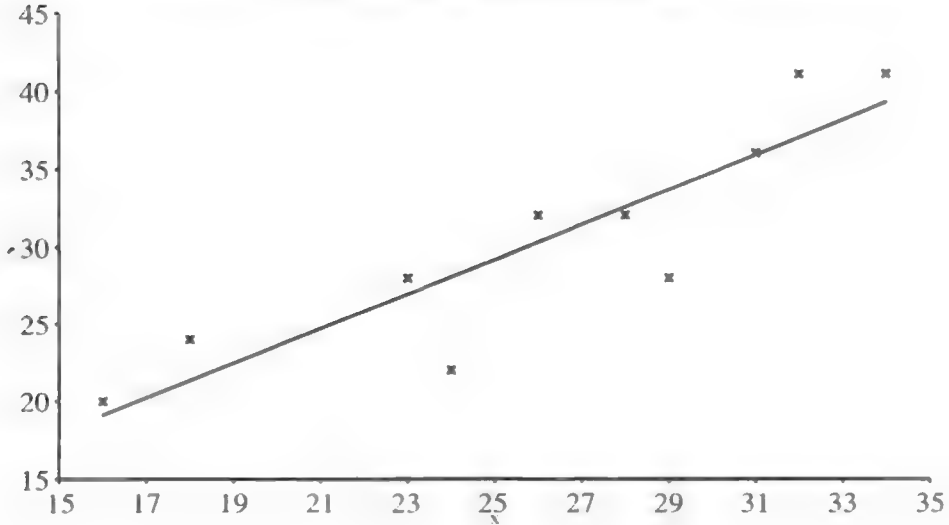
تكون القيمة الدنيا للمقدار السابق محققة عندما:

$$\hat{a}_1 = \frac{\sum_{t=1}^n (y_t - \bar{y})(x_t - \bar{x})}{\sum_{t=1}^n (x_t - \bar{x})^2}, \quad \hat{a}_0 = \bar{y} - \hat{a}_1 \bar{x}$$

يبين الشكل البيانى رقم (٢) مفهوم توفيق البيانات للمعطيات المعروضة فى الجدول رقم (١).



الشكل البياني رقم (٣) مفهوم توفيق البيانات



ويكون هناك دائماً خطأ مرتبط بتقدير المعاملات  $a_1$  و  $a_0$  وهذا الخطأ يقاس بالانحراف المعياري، ومن ثم لا بد من تحديد مقدار هذا الخطأ والتأكد من أنه ليس كبيراً كي لا تكون العلاقة المكتشفة بين المتغيرين موضع شك. سنشرح في الفقرة ٢، ٢ اختباراً إحصائياً يسمح لنا بمعرفة فيما إذا كانت قيمة هذين المؤشرين مختلفة معنوياً عن القيمة صفر أم لا (إذا كانت قيمة المعامل مساوية للصفر فذلك يعني غياب التأثير للمتغير التفسيري الموافق).

هذا النموذج ذو المتغير التفسيري الواحد يبدو الأبسط لعلاقات يمكن أن تكون أكثر تعقيداً ولذلك من المفضل أخذ أكثر من متغير تفسيري واحد بعين الاعتبار في النموذج المدروس.

## ٢-٢- النماذج ذات المتغيرات التفسيرية - الاقتصاد القياسي:

تحتوي النماذج المستخدمة في العلوم الاقتصادية على أكثر من متغير تفسيري خارجي واحد، وتستخدم الطرائق الاقتصادية القياسية لتقدير إجمالي معاملات هذا النموذج، وهي تربط بين المتغير التابع (الواجب تفسيره) والمتغيرات الأخرى الخارجية المستقلة (التفسيرية). على سبيل المثال:

$$y_t = a_1 x_{1t} + a_2 x_{2t} + a_3 x_{3t} + a_0 + \varepsilon_t$$

يمثل نموذجاً بثلاثة متغيرات تفسيرية  $x_{1t}$ ,  $x_{2t}$ , و  $x_{3t}$  وأربعة معاملات  $a_0$ ,  $a_1$ ,  $a_2$ , و  $a_3$ .  
يمثل الخطأ  $\varepsilon_t$  الانحراف بين النموذج النظرى الممثل للظاهرة وبين القيم المشاهدة على إجمالى العينة ولذلك هذا الخطأ مجهول. نرسم لتقدير هذا الخطأ بالرمز ( $e_t$ ) ويسمى بالبواقي (الفرق بين قيم المبيعات المقدرة ( $\hat{y}_t$ ) بواسطة المتغيرات التفسيرية وبين المشاهدات ( $y_t$ )).

يكتب النموذج المقدر بالطريقة التالية:

$$y_t = \hat{a}_1 x_{1t} + \hat{a}_2 x_{2t} + \hat{a}_3 x_{3t} + \hat{a}_0 + e_t$$

قيم المؤشرات المقدرة هي  $\hat{a}_0$ ,  $\hat{a}_1$ ,  $\hat{a}_2$ , و  $\hat{a}_3$  وتمثل البواقي أى الفرق بين القيم المشاهدة والقيم المصححة:  $e_t = y_t - \hat{y}_t$  حيث  $\hat{y}_t = \hat{a}_1 x_{1t} + \hat{a}_2 x_{2t} + \hat{a}_3 x_{3t} + \hat{a}_0$ .

تتشابه طريقة التقدير للنموذج بعدة متغيرات مع تلك الخاصة بمتغير تفسيرى واحد أى دائماً بالاستناد إلى تصغير مجموع مربعات الأخطاء إلى حده الأدنى، إلا أن علاقات الحساب تصبح أكثر تعقيداً وننتقل من فضاء متغيرين اثنين إلى فضاء ذو  $k+1$  متغيراً حيث تمثل  $k$  عدد المتغيرات التفسيرية. يمكن استخدام البرنامج إكسل لإجراء هذا التقدير وسنرى ذلك لاحقاً فى الفقرة (٤.٢).

يمكن لنماذج التقدير أن تكون متزامنة، أى أن المتغيرات جميعها مرتبطة بالفترة الزمنية نفسها ولكن عملياً وعند استخدامنا لمعطيات شهرية أو حتى أسبوعية يمكن لتأثير المتغيرات أن يكون منزاحاً (متأخراً) زمنياً، فتأثير الدعاية أو إجراء الحسومات يمكن أن يستمر لشهرين أو ثلاثة أشهر وفقاً لفترة رد الفعل. وللحصول على العلاقة الصحيحة بين المتغيرات يمكن استخدام نماذج التحليل الزمنى التأخيري. نعرف هنا نموذجاً من هذا النمط:

$$y_t = a_1 x_{1,t-\theta_1} + a_2 x_{2,t-\theta_2} + a_3 x_{3,t-\theta_3} + a_0$$

حيث تمثل  $\theta_i$  التأخيرات الزمنية بين كل من المتغيرات  $x_{it}$  والسلسلة  $y_t$ .

يسمح استخدام النماذج التأخيرية بإجراء وصف أكثر دقة لآليات السببية من خلال تحديد الكمية الدقيقة لتأثيرات العناصر التفسيرية، وتسمح كذلك بتوقع حدوث تغيرات فى الحالة الاقتصادية من خلال استخدامها للمؤشرات الزمنية اللاحقة وهذه الأخيرة تعتبر ذات أهمية كبيرة للقائم على التنبؤ.

## ٢-٣- التفسير الإحصائي للنموذج:

بعد انتقاء النموذج المناسب للتنبؤ وإجراء التقدير الإحصائي له تأتي مرحلة التحقق من مدى ملاءمته الإحصائية ومن أجل ذلك يتم استخدام مجموعة من الاختبارات الإحصائية المرتبطة بالنموذج المقدر.

ولقد جرت العادة على عرض النموذج المقدر مع الاختبارات الإحصائية للمعاملات المقدرة وكيفية التحقق من معنويتها الإحصائية على النحو المعيارى التالى:

$$y_t = \hat{a}_{(t_{a_1})} x_{1t} + \hat{a}_{(t_{a_2})} x_{2t} + \hat{a}_{(t_{a_3})} x_{3t} + \hat{a}_{(t_{a_0})} + e_t$$

$$DW = \dots$$

$$R^2 = \dots$$

$$n = \dots$$

يشتمل هذا النموذج على ثلاثة متغيرات خارجية وتبقى المعالجة المستخدمة بدون تغيير بالنسبة للنماذج ذات المتغيرات أكثر من ثلاثة.

تمثل  $\hat{a}_0, \hat{a}_1, \hat{a}_2, \hat{a}_3$  القيم المقدرة لمعاملات النموذج.

و  $f_{a_1}, f_{a_2}, f_{a_3}, f_{a_0}$  تمثل مؤشرات اختبار ستيودنت.

DW هي اختبار داربين واتسون

R تمثل معامل التحديد (معامل الارتباط المتعدد).

n عدد المشاهدات.

- معاملات النموذج  $\hat{a}_0, \hat{a}_1, \hat{a}_2, \hat{a}_3$ :

تمثل هذه المعاملات أوزاناً أو تثقيات نسبية لكل عنصر من العناصر أو المتغيرات التفسيرية وهذه المعاملات ليست إلا تقديرات للمعاملات الحقيقية المجهولة وذلك لأننا نمتلك فقط عينة من المشاهدات المتوافرة وليس كل المشاهدات. وتعتبر هذه المعاملات متغيرات عشوائية مرتبطة بانحراف معيارى وتمثل التأثير للمتغيرات التفسيرية على الظاهرة المراد تفسيرها أى على المبيعات.

فى حالة النماذج الأخرى المختلفة بشكل بسيط عن النموذج السابق كتلك التى نضيف إليها متغيراً تفسيرياً جديداً أو أن نستبدل متغيراً تفسيرياً بآخر، فإن التقدير

الجديد لمعاملات الانحدار  $\hat{a}_0, \hat{a}_1, \hat{a}_2, \hat{a}_3$  سيكون مختلفاً عن السابق، فحساب معاملات الانحدار يأخذ بعين الاعتبار العلاقات المتداخلة الموجودة بين المتغيرات التفسيرية ومن ثم فإن ذلك يقود إلى تغيرات في تقدير هذه القيم.

- مؤشرات اختبار ستيودنت  $(t_{\hat{a}_1}, t_{\hat{a}_2}, t_{\hat{a}_3}, t_{\hat{a}_4})$ :

يُعتبر كل معامل من المعاملات المقدرة متغيراً عشوائياً ولذلك يرتبط بخطأ ما عند تقديره. وهذا الخطأ يقاس بالانحراف المعياري، وكلما كان تقدير المعامل ذا تشتت كبير (أي قيمة مرتفعة للانحراف المعياري مقارنة مع قيمة المعامل): كان تأثير المتغير التفسيري الموافق مشكوكاً فيه. يمثل مؤشر اختبار ستيودنت النسبة ما بين معامل الانحدار  $(\hat{a}_i)$  وبين انحرافه المعياري  $(\hat{\sigma}_{\hat{a}_i})$ . وتتبع هذه النسبة قانون توزيع ستيودنت وتسمح باختبار فيما إذا كانت قيمة المعامل المقدرة مختلفة معنوياً عن القيمة صفر) أي فيما إذا كان المتغير التفسيري يشرح جزءاً من التقلبات في المبيعات) أو مساوية للصفر. في الحالة الأخيرة يجب حذف المتغير التفسيري من معادلة الانحدار كون تأثيره معدوماً في تقلبات المبيعات.

يتم إجراء الاختبار بالطريقة التالية:

إذا كانت  $t_{\hat{a}_i}^{a/2} > t_{lu}^{a/2}$  تمثل القيمة المقروءة من جدول توزيع ستيودنت عند  $n - k - 1$  درجة حرية ودرجة ثقة  $a$  فإن المعامل  $a_i$  للمتغير  $x_i$  سيكون مختلفاً بشكل معنوي عن القيمة صفر، ومن ثم فإن هذا المتغير يساهم في شرح التقلبات في أرقام المبيعات.

في الحالة المعاكسة نقبل فرضية العدم أي أن المتغير  $x_i$  لا يفسر أي من التقلبات في أرقام المبيعات.

في حال كان عدد المشاهدات أكبر من (٣٠)، فإننا نعتبر  $t_{lu} = 2$ . أما درجة الثقة المعتبرة فإنها عادة ما تكون (٥٪) وذلك يعني قبول الخطأ في (٥٪ من الحالات).

حالة خاصة:

فيما يتعلق بالحد الثابت  $a_0$ ، لا نعطي أهمية لواقع كونه غير مختلف معنوياً عن القيمة صفر وفي الحالات العملية لا نختبره إحصائياً.

## - اختبار داربين واتسون (DW) :

لقد بينت التجربة أن نماذج الانحدار المقدرة للسلاسل الزمنية الاقتصادية تظهر بعض الارتباط الزمني بين القيم المتتالية للحد الممثل لأخطاء التقدير. بالمعنى الاحتمالي فإن ذلك يعنى أن الأخطاء مرتبطة ذاتياً أو أن الخطأ الحاصل عند الزمن  $t$  له تأثير على الخطأ الحاصل فى الزمن  $t + 1$ . لقد قام الباحثان داربين وواتسون فى عام ١٩٥١ بإنشاء اختبار إحصائى لهذه الغاية له الشكل التالى:

$$DW = \frac{\sum_{t=2}^n (e_t - e_{t-1})^2}{\sum_{t=1}^n e_t^2}$$

وحيث  $e_t$  تمثل البواقي (الفقرة ٢-٢).

لاختبار فرضية الارتباط الذاتى للأخطاء، قام داربين وواتسون بوضع جداول للقيم الحرجة<sup>(١)</sup> عند مستوى دلالة (٥٪) تبعاً لحجم العينة  $n$  ولعدد المتغيرات التفسيرية  $k$ . تعطى قراءة الجدول قيمتين  $d_1$  و  $d_2$  محصورتين بين (٠ و ٢).

وفقاً للقيمة التجريبية للإحصاء DW (القيمة المحسوبة) يمكننا استنتاج التالى:

- إذا  $DW < d_1$  فإننا نرفض فرضية الاستقلالية ونقبل بارتباط ذاتى للأخطاء.
  - إذا  $d_1 < DW < d_2$  نكون فى منطقة عدم التحديد فى الجدول ولذا يكون هناك شك.
  - إذا  $d_2 < DW < 4 - d_2$  فإننا نقبل فرضية الاستقلالية للأخطاء.
  - إذا  $4 - d_2 < DW < 4 - d_1$  نكون فى منطقة عدم التحديد من الجدول ومن ثم يكون هناك شك.
  - إذا  $4 - d_1 < DW$  نرفض فرضية الاستقلالية ونقبل بارتباط ذاتى سلبى للأخطاء.
- بالنسبة لحالات الشكل فإننا عملياً نفسرها بعدم وجود ارتباط ذاتى للأخطاء.
- يبين الرسم التوضيحي رقم (٢) القواعد المتبعة فى اتخاذ القرار.

(١) الجداول معروضة فى نهاية الكتاب.

الرسم التوضيحي رقم (٢) تفسير اختبار داربين واتسون

0	$d_1$	$d_2$	2	$4 - d_2$	$4 - d_1$	4
<hr/>						
ارتباط ذاتي موجب		شك	لا ارتباط ذاتياً	شك	ارتباط ذاتي سلبي	

هناك العديد من الأسباب لوجود الارتباط الذاتي نذكر منها:

- تعريف غير مناسب للنموذج فبدلاً من أن تكون العلاقة خطية بين المتغيرات في النموذج يمكن أن تكون لوغاريتمية أو مأخوذة الفرق الأولى.

- غياب متغير تفسيري مهم.

- صقل البيانات. وهذه الظاهرة تتضح في تأثير Slutsky<sup>(١)</sup> (خلق حلقة اصطناعية في السلسلة). فتطبيق فلتر الوسط المتحرك على البيانات له أثر مباشر في التأثير على اختبار داربين واتسون ومن ثم إمكانية توليد ارتباط ذاتي اصطناعي بين الأخطاء.

لا يُعطى اختبار داربين واتسون في معظم الحالات إلا افتراضاً لوجود ارتباط ذاتي بين البواقي من الدرجة الأولى (أي ارتباط بين  $\varepsilon_t$  و  $\varepsilon_{t-1}$ ) دون البحث عن علاقات من درجات أعلى (٢ أو ٣ أو ٤). ومن ثم فإن هذا الاختبار يبقى ذا فائدة محدودة ويمكن الاستعانة بالتمثيل البياني لسلسلة البواقي أو بحساب الـ  $\text{corrélogramme}$ .

- معامل التحديد ( $R^2$ ):

يقيس معامل التحديد جودة توفيق النموذج المقدر وهو يساوي النسبة بين التباين المشروح بواسطة السلاسل التفسيرية وبين التباين الكلي. وهو لا يُعطى حكماً مسبقاً على الجودة الحقيقية للنموذج، ومن ثم على التنبؤ الناتج فهو يرتبط بعدد المتغيرات التفسيرية للنموذج، فعلى سبيل المثال تكون قيمة معامل التحديد لنموذج ذات خمسة متغيرات تفسيرية وخمس مشاهدات مساوية للواحد (خمس معادلات بخمسة مجاهيل) في حين أنه في الحقيقة ليس لهذا النموذج أي فعالية إحصائية ومن ثم لا يمكن الأخذ بالتنبؤ الناتج عنه. بالمقابل من الممكن الوصول إلى نموذج ممتاز مع قيمة (٠,٥) لمعامل التحديد. إذن لا يقيس معامل التحديد إلا جودة توفيق النموذج بالنسبة لنشئت نقاطه البيانية حول المستقيم الممثل للبيانات.

(١) Slutsky (١٩٣٧).

## - مثال لتفسير الانحدار:

ليكن لدينا النموذج المقدّر التالي:

$$y_i = \underset{(2.1)}{3.4} x_{1,i} + \underset{(0.8)}{5.8} x_{2,i} + \underset{(4.4)}{7.4} x_{3,i} + \underset{(7.1)}{3} + e_i$$

$$n = 54$$

$$R^2 = 0.84$$

$$DW = 1.79$$

$$(.) = \text{ratio de Student}$$

يتضح من نتائج التقدير أن المتغير التفسيري  $x_{2,i}$  ليس معنوياً حيث نسبة ستيودنت الخاصة به تساوى (٠,٨) وهى أقل بكثير من القيمة الجدولية ٠,٢. بالمقابل فإن المتغيرات التفسيرية  $x_{1,i}$  و  $x_{3,i}$  مختلفة بشكل معنوى عن القيمة صفر، ومن ثم يجب حذف المتغير التفسيري الثانى من معادلة الانحدار ومن ثم إعادة تقدير النموذج المتبقى من جديد.

النتائج لتقدير النموذج الجديد بعد حذف المتغير الثانى هى على النحو التالى:

$$y_i = \underset{(2.8)}{2.6} x_{1,i} + \underset{(7.5)}{6.5} x_{3,i} + \underset{(1.4)}{4.12} + e_i$$

$$n = 54$$

$$R^2 = 0.81$$

$$DW = 1.88$$

$$(.) = \text{ratio de Student}$$

نلاحظ من نتائج التقدير الجديدة ما يلى:

- انخفاض خفيف فى معامل التحديد بسبب سحب متغير تفسيري من معادلة الانحدار.
- تعديل فى قيم المعاملات الجديدة مقارنة بالقيم السابقة.
- ازدياد فى نسب ستيودنت للمتغيرات التفسيرية وبشكل خاص للمتغير التفسيري الثالث مما يعنى ارتباطاً مهماً بين المتغير الثانى والثالث (فكلاهما يشرح الظاهرة نفسها). إن عملية حذف المتغير الثانى قد حسّنت بشكل كبير تقدير المعامل الثالث.

- نسبة ستيدونت للحد الثابت أقل من ٢ ومن ثم فإن المعامل  $a_0$  لا يختلف بشكل معنوي عن القيمة صفر وهذا كما ذكرنا سابقاً ليس بالأمر المهم.
- لا تدل قيمة اختبار داربين واتسون على وجود ارتباط ذاتي في بواقي التقدير (من خلال النظر إلى القيم الجدولية وعند  $k = 2$  نجد  $d_1 = 1.49$  و  $d_2 = 1.64$ ) مما يكون في صالح استقلالية الأخطاء ومن ثم ملائمة النموذج.
- معامل التحديد يشير إلى توفيق صحيح للملاحظات.
- الخلاصة يمكن القبول بهذا النموذج لإجراء التنبؤ.

#### ٢-٤- أمثلة للتقدير الاقتصادي القياسي بواسطة تقنيات البرنامج إكسل:

ليكن لدينا النموذج الاقتصادي التالي المكوّن من معطيات شهرية لمغیر المبيعات الواجب تفسيره وثلاثة متغيرات تفسيرية ذات صلة بالمغیر التابع (الجدول ٦) وهذه البيانات تغطي فترة ثلاث سنوات:

- ventes = حجم مبيعات المنشأة المصححة من التقلبات الفصلية أي CVS.
- promo = المنفق على عمليات الترويج للمبيعات والمقاس بآلاف الفرنكات الفرنسية.
- pub = الإنفاق على الإعلان والدعاية والمقاس بآلاف الفرنكات الفرنسية.
- trend = التطور الطبيعي<sup>(١)</sup> للمبيعات ممثلاً في مركبة الاتجاه العام.

الجدول رقم (٦) المبيعات، التخفيضات والدعاية (ملف C4EX2.XLS)

التاريخ	ventes	promo	pub	trend	التنبؤ
السنة ١-ك٢	٧٢٨١	٥٩٧	٣١٠٩	١	٥٥٧١,٢٧
شباط	٩١٦٣	٢١٣٩	٢٦٧	٢	٧٣١٥,٩٠
آذار	٧٧٦٩	٨٥٩	٣٥٤٩	٣	٦٣٥٠,٨٥
نيسان	٨٤٨٥	٧١٧	٥٠٨٣	٤	٦٧٢١,٩٠
أيار	٧٦٠٦	٢٠٣٣	٤٠٥١	٥	٨٦٩٤,٦٤
حزيران	٧٣٦٤	١٨٦٣	٨٢٦	٦	٧٤١٣,٠٠

(١) نمو الطلب الأولى.



تابع - الجدول رقم (٦).

التاريخ	ventes	promo	pub	trend	التنبؤ
تموز	٦٧١١	١٣٩٣	٤٥٩٠	٧	٧٩٨١,٢٣
آب	٣٤٠٧	٦٠٣	١١٧	٨	٥٢٢٩,٤٣
أيلول	٤٨٦٢	١٧٠٢	٣٣٨٨	٩	٨٢٨٦,٤٥
ت١	١١٤٦٤	٣٨٩١	٢٦٦٨	١٠	١١٨٤١,٧٤
ت٢	١٠٢٩١	٣٩٦٨	٢٦١٥	١١	١٢٠٤٨,٠٦
ك١	٩٧٨٩	٢٨٦٧	١١٣٠	١٢	٩٧٧٧,٩٠
السنة ٢-ك٢	٨٠٨٢	٢٥٠	٥٩٤٨	١٣	٧٠٦٨,٤٨
شباط	٨٦٦٣	٣٤٢	١٧١٥	١٤	٥٨٩٠,١٨
آذار	٧٧٢٠	٨٢٣	٣٦٦	١٥	٦٣٤٢,٩٩
نيسان	٧٨٥٩	٥٨٤	٦٠٠٥	١٦	٧٩٣٤,٦٠
أيار	٦٩٣٦	٨١٣	١١٥	١٧	٦٤٢٩,١٩
حزيران	٦٢٩٢	٠	٠	١٨	٥١٠٨,٥٢
تموز	٧٥٧٢	٠	٢٣٣٦	١٩	٥٩٩٠,٤٠
آب	٣٥٨٨	١٠٧٧	٠	٢٠	٧١١٨,٨٣
أيلول	٧١٥٢	٨٧٤	٦٧٤	٢١	٧٠٩٦,٥٦
ت١	١٠٦٧٢	٢٩٧٨	٥	٢٢	١٠٥٢٥,٢١
ت٢	٨٥٢٢	١٠٦٦	٧٣٣٨	٢٣	٩٨٥٧,١٧
ك١	٨٦٨٨	٣٠	٤٠٣٦	٢٤	٧٠٨٤,٠٩
السنة ٣-ك٢	٥٧٧٢	٨٠٣	٥٢٨١	٢٥	٨٩٠٦,٠٤
شباط	٧٦٨٢	١٩٨٤	١٨٨٧	٢٦	٩٨٥٣,٥٧
آذار	٨٨١٤	١٠٤٤	١١٥	٢٧	٧٧٥٩,٠٥
نيسان	١٠٨٦٤	٣١٢٣	٠	٢٨	١١٣٣٢,٢٧

تابع - الجدول رقم (٦).

التاريخ	ventes	promo	pub	trend	التنبؤ
أيار	٥٤٦١	٥٧٢	٤٣٤٨	٢٩	٨٥٧٦,٠٠
حزيران	١٣١٠٩	٤٤٨٣	٦٩	٣٠	١٣٨٤٤,٧٦
تموز	١٦٦٤٩	٥٣٢٨	٥٠١٢	٣١	١٧٠٣٥,٩٥
آب	١٢٤٦٧	٣٨٩٠	٧١	٣٢	١٣٠٢٩,٧٤
أيلول	١٨٢٧٧	٦٣٤٨	٢١٢٨	٣٣	١٧٩٧٦,٩٧
ت١	٢٠٨٣٦	٧٢١٠	٣٨٧٩	٣٤	٢٠١٢٠,٢١
ت٢	١٨٢٥٣	٣٧٩٠	٣٧٨٢	٣٥	١٤٣٩٤,٠٠
ك١	١٧٤٨٣	٣٦٧٨	٦١٥٢	٣٦	١٥٠٩٧,٨٢
السنة ٤-ك٢		٥٩٧	٣١٠٩	٣٧	٨٩٥١,٥٣
شباط		٢١٣٩	٢٦٧	٣٨	١٠٦٩٦,١٦
آذار		٨٥٩	٣٥٤٩	٣٩	٩٧٣١,١١
نيسان		٧١٧	٥٠٨٣	٤٠	١٠١٠٢,١٦
أيار		٢٠٣٣	٤٠٥١	٤١	١٢٠٧٤,٩٠
حزيران		١٨٦٣	٨٢٦	٤٢	١٠٧٩٣,٢٥
تموز		١٣٩٣	٤٥٩٠	٤٣	١١٣٦١,٤٩
آب		٦٠٣	١١٧	٤٤	٨٦٠٩,٦٩
أيلول		١٧٠٢	٣٣٨٨	٤٥	١١٦٦٦,٧١
ت١		٣٨٩١	٢٦٦٨	٤٦	١٥٢٢٢,٠٠
ت٢		٣٩٦٨	٢٦١٥	٤٧	١٥٤٢٨,٣٢
ك١		٢٨٦٧	١١٣٠	٤٨	١٣١٥٨,١٦

## - استخدام الدالة "DROITREG":

الجدول رقم (٧) نتائج استخدام الدالة DROITREG

٩٣,٨٩٦٠	٠,٣٣٧٣	١,٦٩٢٢	٣٤١٨
٣٤,٥٢٩٧	٠,١٤٢٧٦	٠,١٩٦٠	٧٣١,٤
٠,٨١٨١	١٨٧٠,١٧١٧	N/A	N/A
٤٧,٩٩٠٤	٣٢	N/A	N/A
٥٠٣٥٤٦٠٦٨,٦	١١١٩٢١٣٥٠,٤	N/A	N/A
٩٣,٨٩/٣٤,٥٣=٢,٧٢	٢,٣٦	٨,٦٣	نسبة ستيودنت ٤,٦٧

الجدول رقم (٨) أسماء المؤشرات الموافقة للجدول رقم (٧) السابق

$\hat{a}_3$	$\hat{a}_2$	$\hat{a}_1$	$\hat{a}_0$
$\hat{\sigma}_{ii}$	$\hat{\sigma}_{ii}$	$\hat{\sigma}_{ii}$	$\hat{\sigma}_{ii}$
$R^2$	$\hat{\sigma}_f$	N/A	N/A
$F$	درجات الحرية	N/A	N/A
SCT	SCR	N/A	N/A

تظهر القيم المقدرة للمعاملات على السطر الأول من الجدولين (٧ و ٨) أسفل كل معامل وفي السطر الثاني تظهر قيم الانحراف المعياري الموافقة كما نلاحظ وجود قيمة معامل التحديد  $R^2 = 0.81$  في تقاطع العمود الرابع والسطر الثالث. أما عدد درجات الحرية فيساوي  $32 = 36 - 4$  ويظهر في تقاطع العمود الثالث مع السطر الرابع.

تم وضع قيم مؤشرات اختبار ستيودنت أسفل الجدول ٧ وتعني الإشارة N/A عدم وجود قيمة في ذلك المكان.

نعرض هنا بعض الصيغ الرياضية لمؤشرات تم عرضها في الجدولين السابقين:

$$\hat{\sigma}_\varepsilon = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n e_i^2}{n - k - 1}} = 1870.17 \text{ - الانحراف المعياري للبواقي:}$$

- القيمة التجريبية لاختبار فيشر:  $F^* = \frac{R^2/k}{(1 - R^2) / (n - k - 1)}$

- مجموع المربعات الكلى:  $SCT = \sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})$

- مجموع مربعات البواقي:  $SCR = \sum_{i=1}^n e_i^2$

- استخدام أدوات توضيح إضافية:

يمكن أيضاً الحصول على النتائج نفسها ولكنها مفسرة بشكل أفضل من خلال الجداول النفعية الموجودة ضمن البرنامج إكسل فى القائمة وتحت اسم "outil" (الجدول ٩).

مما تجدر الإشارة إليه إلى أن أى تعديل فى المعطيات الموجودة فى ورقة العمل سيؤدى إلى تعديل آلى فى نتائج استخدام الدالة "DROITREG" ولكن ليس على الجداول النفعية outil.

- التفسيرات الإحصائية الاقتصادية والتنبؤ:

يلاحظ أن نسب ستيودنت جميعها أكبر من ٢ ومن ثم فإن قيم معاملات المتغيرات التفسيرية مختلفة بشكل معنوى عن القيمة صفر مما يعنى مساهمة المتغيرات التفسيرية فى شرح التقلبات فى أرقام المبيعات.

الجدول رقم (٩) نتائج التقدير المفصلة

		مؤشرات الانحدار	
٠,٩٠		معامل التحديد المتعدد	
٠,٨٢		معامل التحديد $\hat{R}_2$	
٠,٨٠		معامل التحديد المصحح $\hat{R}_2$	
١٨٧٠,١٧		الخطأ المعيارى	
٣٦		عدد المشاهدات	
الإحصاء t	الخطأ المعيارى	المعاملات	الثابت
٤,٦٧	٧٣١,٣٩	٣٤١٨,٣٩	الثابت
٨,٦٣	٠,٢٠	١,٦٩	PROMO
٢,٣٦	٠,١٤	٠,٣٤	PUB
٢,٧٢	٣٤,٥٣	٩٣,٩٠	TREND

نلاحظ كذلك أن أكثر المتغيرات التفسيرية مساهمةً في شرح التقلبات في أرقام المبيعات هو متغير ترويج المبيعات (التخفيضات) حيث قيمة مؤشر ستودنت تساوى (٨,٦٣) وهى الأكثر ارتفاعاً، وهذا المتغير هو أيضاً الأكثر مردودية حيث كل وحدة نقدية تُستخدم في هذا المجال تؤدي إلى زيادة (١,٦٩) وحدة من المبيعات في حين أن كل وحدة نقدية مستثمرة في الإعلان تؤدي إلى (٠,٣٤) وحدة مبيعات.

يمكننا الآن حساب التنبؤ للمبيعات بالاستناد إلى القيم المعلومة للمتغيرات التفسيرية وذلك من خلال النموذج التالى:

$$VENTE = 3418.39 + 1.69 PROMO + 0.34 PUB + 93.90 TREND$$

فمن أجل التنبؤ لشهر كانون الثانى للعام الرابع، يكون لدينا:

$$\begin{aligned} PREVISION_{4,J} &= 3418.39 + 1.69 PROMO_{4,J} + 0.34 PUB_{4,J} + 93.90 TREND_{4,J} \\ &= 3418.39 + 1.69 \times 597 + 0.34 \times 3109 + 93.90 \times 37 = 8951.53 \end{aligned}$$

وهكذا من أجل باقى القيم.

## ٢-٥- اختيار المتغيرات التفسيرية:

غالباً ما يواجه القائم على التنبؤ في المنشأة التجارية مشكلة تتعلق بانتقاءه للمتغيرات التفسيرية الواجب إدخالها في النموذج المستخدم للتنبؤ وحيث هناك بعض المتغيرات التى تحمل المعلومات نفسها بخصوص شرح التقلبات في أرقام المبيعات والتي لا يمكن إدخالها جميعاً فإننا هنا سنستعرض أربع طرائق تسمح بهذا الانتقاء. وبشكل عام يتم انتقاء المتغيرات بحيث:

- تكون أكثر ارتباطاً بمتغير المبيعات.

- تكون الأقل ارتباطاً فيما بينها.

سنشرح هذه الطرائق من خلال المعطيات المعروضة في الجدول رقم (١٠) التالى.

الجدول رقم (١٠) كيفية انتقاء المتغيرات التفسيرية (الملف C4EX3.XLS):

$x_{3i}$	$x_{2i}$	$x_{1i}$	$y_i$
١٢١	٤٥	٢	١٢
١٣٢	٤٣	١	١٤
١٥٤	٤٣	٣	١٠
١٤٥	٤٧	٦	١٦
١٢٩	٤٢	٧	١٤
١٥٦	٤١	٨	١٩
١٣٢	٣٢	٨	٢١
١٤٧	٣٣	٥	١٩
١٢٨	٤١	٥	٢١
١٦٣	٣٨	٨	١٦
١٦١	٣٢	٤	١٩
١٧٢	٣١	٩	٢١
١٧٤	٣٥	١٢	٢٥
١٨٠	٢٩	٧	٢١

- طريقة إجراء كل الانحدارات الممكنة:

الطريقة الأكثر يقيناً تقضى بتقدير كل الانحدارات الممكنة واختبارها، ومن ثم اختيار الأكثر فعالية ومناسبة للمعطيات، إلا أن هذه الطريقة تصبح أحياناً شبه مستحيلة بسبب كثرة المتغيرات التفسيرية.

فعندما يصبح عدد المتغيرات التفسيرية  $k$  كبيراً فإن ذلك يترتب عليه إجراء  $2^k - 1$  معادلة انحدار أى (١٠٢٣) معادلة انحدار فى حالة وجود (١٠) متغيرات تفسيرية و (١٠٤٨٥٧٥) معادلة انحدار فى حالة (٢٠) متغيراً تفسيرياً.

بالنسبة للمعطيات المعروضة فى الجدول رقم (١٠) يكون لدينا  $2^3 - 1 = 7$  نماذج مختلفة واجب تقديرها ولكى نخفف من العرض الجدولى فى هذا الفصل، فإننا لن نعرض جميع النتائج وسيتم اتباع الطريقة التالية فى اختيار النموذج الأمثل:

- حذف كل نموذج تكون فيه قيمة واحد على الأقل من المتغيرات التفسيرية غير مختلفة بشكل معنوى عن القيمة صفر (دون اعتبار الحد الثابت).

- الاختيار من بين النماذج المتبقية، النموذج الذى يعطى القيمة الأكبر لمعامل التحديد.

من خلال مثالنا يمكن للقارئ التأكد من أن النموذج الأمثل هو ذلك الذى يحتوى على المتغيرات  $x_{17}$  و  $x_{27}$ .

#### - طريقة الحذف المتتابع (Backward Elimination):

تستند هذه الطريقة إلى إجراء حذف متسلسل للمتغيرات غير التفسيرية. بحيث بعد كل حذف يُعاد التقدير من جديد على المتغيرات المتبقية ومعيار الحذف هو النظر إلى القيمة التجريبية لمؤشر ستيودنت ومقارنتها مع القيمة الجدولية. لا يمكن استخدام هذه الطريقة إلا إذا كانت المعادلة الأولى ممكنة التقدير فعلياً وهذا ليس دائماً ممكناً ففى بعض الحالات، عندما يكون عدد المتغيرات التفسيرية كبيراً، يكون هناك احتمال كبير لوجود ارتباطات شديدة بين المتغيرات التفسيرية فيما بينها أو ما يسمى بظاهرة *colinéarité*.

الانحدار الأول:

$\hat{a}_3$	$\hat{a}_2$	$\hat{a}_1$	$\hat{a}_0$	
-٠.٠٣٧١	-٠.٣٨١٤	٠.٨٠١٩	٣٢.٨٩١٣	المعامل
٠.٠٥	٠.١٦	٠.٣٠	١١.٦٦	الانحراف المعياري
٠.٧١	٢.٤٤	٢.٦٩	٢.٨٢	مؤشر ستيودنت t

المتغير الثالث ليس معنوياً ( $t_{cal} = 0.71 < 2$ ) ومن ثم سيتم حذفه من النموذج.

$\hat{a}_2$	$\hat{a}_1$	$\hat{a}_0$	
-٠.٣٢٨١	٠.٧١٤٩	٢٥.٨٤٢١	المعامل
٠.١٣	٠.٢٧	٦.٠٦	الانحراف المعياري
٢.٤٤	٢.٦٨	٤.٢٦	مؤشر ستيودنت t

كل المتغيرات الآن مختلفة بشكل معنوى عن القيمة صفر، ومن ثم يكون النموذج المقدر هو النموذج المناسب.

#### - طريقة الإدخال المتتابع (Stepwise Regression):

فى هذه الطريقة نتجه اتجاهاً معاكساً حيث يتم انتقاء المتغيرات التفسيرية واحداً بعد الآخر حسب درجة مساهمتها فى شرح التقلبات فى المتغير التابع. ففى بدء الأمر

نختار المتغير التفسيري الأكثر ارتباطاً بسلسلة المبيعات، وبعد ذلك يتم إدخال المتغير الذى يشرح أكبر قدر ممكن من التباين لسلسلة المبيعات وذلك وفقاً لمعيار مؤشر ستيودنت وتتوقف عملية إدخال المتغيرات عند عدم بقاء أى متغير تفسيري يشرح التقلبات فى المتغير التابع أى المبيعات.

- المرحلة ١: اختيار المتغير التفسيري الأكثر ارتباطاً بمتغير المبيعات. من أجل ذلك نحسب معاملات الارتباط بين المبيعات وكل من المتغيرات الثلاثة وكذلك نحسب مؤشر ستيودنت الموافق (الفقرة ١-١-١):

$x_{3t}$	$x_{2t}$	$x_{1t}$	
٠.٤٨	٠.٦٩-	٠.٧٢	الارتباط
٢.٠٥	٣.٦١	٣.٨٨	مؤشر ستيودنت

نعمد المتغير الأول الأكثر ارتفاعاً فى معامل ارتباطه مع المتغير التابع.

- المرحلة ٢: إجراء التقدير الإحصائى لنموذجين، باعتماد المتغيرين التفسيريين الأول والثانى للنموذج الأول والأول والثالث للنموذج الثانى.

$$y_t = a_1 x_{1t} + a_2 x_{2t} + a_0 + \varepsilon_t$$

$\hat{a}_0$	$\hat{a}_1$	$\hat{a}_2$	
٢٥.٨٤٢١	٠.٧١٤٩	٠.٣٢٨١-	المعامل
٦.٠٦	٠.٢٧	٠.١٣	الانحراف المعيارى
٤.٢٦	٢.٦٨	٢.٤٤	قيمة مؤشر ستيودنت

$$y_t = a_1 x_{1t} + a_3 x_{3t} + a_0 + \varepsilon_t$$

$\hat{a}_0$	$\hat{a}_1$	$\hat{a}_3$	
٨.٦٠٩٢	٠.٩٢٧٢	٠.٠٢٣٢	المعامل
٧.٢٨	٠.٣٥	٠.٠٦	الانحراف المعيارى
١.١٨	٢.٦٢	٠.٤٢	قيمة مؤشر ستيودنت



المتغير الثانى المنتقى (أى  $x_{2i}$ ) هو ذلك المتغير الذى له القيمة المطلقة الأكبر لمؤشر ستيودنت.

- المرحلة ٣: تقدير النموذج بثلاثة متغيرات، الأول والثانى (لذين تم انتقاؤهم أولاً) والمتغير الثالث (الوحيد المتبقى)، أى:

$$y_i = a_1 x_{1i} + a_2 x_{2i} + a_3 x_{3i} + a_0 + \varepsilon_i$$

لدينا سابقاً النتيجة للتقدير الأخير من خلال طريقة الحذف المتتالى، ومن ثم تتوقف الطريقة هنا؛ لأن المتغير الثالث غير معنوى من وجهة نظر مؤشر اختبار ستيودنت، ونكون بصدد اعتماد النموذج نفسه الذى تم انتقاؤه بواسطة الطرائق السابقة.

- طريقة الانحدار بدرجات (Stagewise Regression) (الملف C4EX4.XLS):

تسمح هذه الطريقة بالبحث عن المساهمات الهامشية ولكن المعنوية لكل متغير من المتغيرات التفسيرية المرشحة.

وكما هو الحال فى الطريقة السابقة، نأخذ المتغير التفسيري ذا العلاقة الأشد مع متغير المبيعات ومن ثم فإننا نجرى انحداراً أولياً ينتج عنه سلسلة البواقي وهذه الأخيرة تعتبر متغيراً تابعاً جديداً يجب تفسيره. بعد ذلك ننتقى المتغير التفسيري الأكثر ارتباطاً بمتغير البواقي السابق ونجرى انحداراً جديداً بمتغيرين مما ينتج عنه متغير بواقي جديد ونحاول تفسيره بمتغير تفسيري آخر وهكذا ... .

- المرحلة ١: انتقاء المتغير التفسيري الأكثر ارتباطاً بمتغير المبيعات.

نحسب من أجل ذلك معاملات الارتباط البسيطة بين المبيعات وكل من المتغيرات التفسيرية، وكذلك مؤشر ستيودنت لكل متغير ونتيجة هذه العملية نختار المتغير التفسيري الأول كونه الأكثر ارتباطاً بمتغير المبيعات.

- المرحلة ٢: نجرى تقديراً للنموذج المتضمن المتغير التفسيري الأول ونحسب سلسلة البواقي.

$$y_i = \hat{a}_1 x_{1i} + \hat{a}_0 + e_{1i}$$

$$e_{1i} = y_i - (\hat{a}_1 x_{1i} + \hat{a}_0)$$

$$y_i = 1.0118 x_{1i} + 11.57 + e_{1i}$$

تسمح لنا المعاملات المقدرة بحساب البواقي  $e_{1i}$ :

$$e_{1i} = y_i - (1.0118 x_{1i} + 11.57)$$

فعلى سبيل المثال يكون لدينا:

$$e_{1,1} = 12 - (1.0118 \times 2 + 11.57) = -1.59$$

$$e_{1,2} = 14 - (1.0118 \times 1 + 11.57) = 1.42$$

....

$$e_{1,14} = 21 - (1.0118 \times 7 + 11.57) = 2.35$$

- المرحلة ٣: حساب معاملات الارتباط البسيطة بين  $e_{1i}$  ومختلف  $x_{ij}$ .

$x_{3i}$	$x_{2i}$	$x_{1i}$	
٠,١٠-	٠,٥٣-	٠,٠٠	الارتباط
٠,٣٩	٢,٢٢	٠,٠٠	مؤشر ستيودنت t

المتغير الثانى هو المنتقى هنا حيث معامل ارتباطه يعتبر الأكثر ارتفاعاً بالقيمة المطلقة.

نلاحظ أن معامل الارتباط بين  $e_{1i}$  و  $x_{1i}$  معدوماً؛ لأن المتغير  $e_{1i}$  يمثل سلسلة المبيعات التى منها سحبنا تأثير  $x_{1i}$ .

- المرحلة ٤: تقدير النموذج بمتغيرين تفسيريين الأول والثانى ثم حساب البواقي.

$$e_{2i} = y_i (\hat{a}_1 x_{1i} + \hat{a}_2 x_{2i} + \hat{a}_0)$$

تسمح لنا المعاملات المقدرة بحساب البواقي  $e_{2i}$ :

$$e_{2i} = y_i - (0.71 x_{1i} + 0.33 x_{2i} + 25.84)$$

فيمكننا على سبيل المثال حساب:

$$e_{2,1} = 12 - (0.71 \times 2 + 0.33 \times 45 + 25.84) = -0.51$$

$$e_{2,2} = 14 - (0.71 \times 1 + 0.33 \times 43 + 25.84) = 1.55$$

....

$$e_{2,14} = 21 - (0.71 \times 7 + 0.33 \times 29 + 25.84)$$

- المرحلة ٥: حساب معاملات الارتباط البسيطة بين  $e_{2,t}$  وجميع المتغيرات  $x_{1,t}$ .

$x_{1,t}$	$x_{1,t}$	$x_{1,t}$	
-٠,١٦	٠,٠٠	٠,٠٠	الارتباط
٠,٦٠	٠,٠٠	٠,٠٠	مؤشر ستيودنت $t$

هنا نتوقف هذه الطريقة بسبب عدم وجود أى معامل ارتباط مختلف معنوياً عن القيمة صفر بين متغير البواقي والمتغيرات التفسيرية الأخرى.

يسمح تحليل البواقي فى كل مرحلة باستخلاص أكبر قدر ممكن من المعلومات عن المتغيرات التفسيرية من خلال تخفيض الارتباطات الداخلية بين هذه المتغيرات إلى الحد الأدنى. وهذا مبرر اقتصادياً بشكل كامل، فيمكن لصناعة ما أن تكون مرتبطة (٦٠٪) بقطاع أول و(٣٠٪) بقطاع آخر و(١٠٪) بقطاع آخر، ومن ثم فإن التفسير بواسطة البواقي للقطاع الثانى يصبح جلياً بعد استخلاص التفسير من القطاع الأول أما تأثير القطاع الثالث فيصبح أكثر وضوحاً على بواقي الـ (٩٠٪) التى سبق أن تم شرحها. إذن يمكننا تبيان التفسيرات الهامشية ولكن المعنوية لكل من المتغيرات التفسيرية.

تعتبر أدوات الاقتصاد القياسى مفيدة فى هذا المجال فهى لا تبحث فقط عن شرح التغيرات فى السلسلة نفسها إنما فى تقلبات سلاسل زمنية أخرى نعتقد فى تأثيرها حدسياً. وتسمح هذه الأدوات باختبار واضح للعلاقات الممكنة بشكل ضمنى.

إحدى سلبيات هذا النوع من الأدوات تكمن فى صعوبة وضعها موضع التنفيذ، إلا أن استخدام البرامج الجدولية يخفف من هذه السلبية ويجعل تدخل المستخدم مقتصرًا فقط على صياغة النموذج المناسب ومن ثم التأكد من مدى صلاحيته واختيار المتغيرات التفسيرية.

## الجزء الثانى

### استخدام التنبؤ فى القطاعات المختلفة

بعد تجهيز الأدوات المناسبة لإجراء التنبؤ تأتى مرحلة استخدام تلك الأدوات فى القطاعات المختلفة. وسوف نبدأ مع القطاع الصناعى (الفصل الخامس) الذى يعتبر من المجالات المناسبة لاستخدام النماذج التفسيرية، وبشكل خاص بالنسبة للسلع الصناعية الوسيطة ذات العلاقة بالقطاعات النهائية المستعملة لتلك السلع التى تسمح باستخدام النماذج ذات المؤشرات التقديمية. ومن خلال هذا الفصل سنتعمق فى طريقة صياغة النموذج وسنعرض مثلاً كاملاً للنموذج ذى المؤشرات التقديمية.

نخصص (الفصل السادس) لقطاع السلع الاستهلاكية المعمرة وسندرس الخصائص النوعية لهذا القطاع، مثل وجود سوق مضاعف لهذا النوع من السلع، وسوق التجهيز الأولى من السلعة وسوق الاستبدال وكذلك خاصية إدخال بعض الحوادث الاستثنائية التى تحدث قرارات استثمارية من قبل قطاع العائلات. سنعرض مثلاً متكاملًا يتعلق بقطع الغيار والتجهيزات فى سوق السيارات.

نعالج فى (الفصل السابع) بعض أوجه التنبؤ بالمبيعات الخاصة بالسلع ذات الاستهلاك الكبير، حيث سنشرح تأثير منحنى حياة المنتج على هذا النوع من السلع، فمسائل التنبؤ مرتبطة بشكل كبير بوضع المنتج ضمن دورة حياته، كما سيتم إدخال السياسة التسويقية للمنشأة فى النموذج المدروس مما يقود إلى الأخذ بعين الاعتبار تأثير بعض الأحداث الخاصة مثل تلك المتعلقة بسياسة ترويج المبيعات والدعاية، وسيكون هناك شرح متكامل لنظام التنبؤ الأسبوعى لمنشأة تعمل فى هذا القطاع.

نخصص (الفصل الثامن) للتنبؤ بالمبيعات باستخدام قواعد المعطيات الضوئية (Scanners) المأخوذة من مشتريات المستهلكين فى المجمعات الاستهلاكية الكبيرة، والغاية من ذلك هى التنبؤ بتأثير السياسات التسويقية المختلفة. ومن أجل ذلك سنستخدم النموذج المنطقى "Logit" ونستعرض أدواته التجريبية المستخدمة وكيفية إعطاء تنبؤات سنوية على المستوى الوطنى.

أخيراً، سيكون الفصل الأخير مخصصاً لبعض المسائل الخاصة جداً بأنماط محددة من الأنشطة مثل تلك المتعلقة بالتنبؤ لمجالات زمنية قصيرة جداً مثل التنبؤ اليومى والتنبؤ للمنتجات ذات مدد الحياة القصيرة.



## الفصل الخامس التنبؤ في الوسط الصناعي

يتميز التنبؤ في الوسط الصناعي بخصائص محددة جداً، فالسلع الصناعية تخضع في تحركاتها الزمنية لما يسمى بمنطقة القطاع الأعلى (secteur amont) (الفقرة الأولى). فالتقلبات في أرقام المبيعات تكون مرتبطة بالطلب النهائي مع تأثير زمني تأخيري بسبب وجود مجموعة من الحلقات الصناعية.

ولهذا السبب فإنه يتم استخدام النماذج الزمنية ذات المؤشرات التأخيرية (الفقرة الثانية) التي تشرح المبيعات لمنْتَج صناعي ما كتوفيق لعدة متغيرات تفسيرية ذات تأخيرات زمنية مختلفة.

هناك الكثير من المؤشرات التفسيرية المتاحة، ولكن يُفضل إجراء تحويلات على هذه المؤشرات مما يجعلها أكثر تمثيلاً للظواهر التفسيرية التي نرغب في أخذها بعين الاعتبار، وهذا سيكون موضوع الفقرة الثالثة من هذا الفصل.

نستعرض أخيراً في الفقرتين الرابعة والخامسة نظامين من أنظمة التنبؤ تتعلقان بصناعات محددة هي صناعة الفولاذ المقاوم للصدأ وصناعة التجهيزات الإلكترونية.

### ١- السلع الصناعية ومبدأ القطاع الأعلى (الأساس):

#### ١-١- الأنماط المختلفة للإحصائيات الصناعية:

تخضع السلاسل الزمنية للمنتجات الصناعية عادة لتقلبات كبيرة ومهمة وغير منتظمة وهي تتميز بوجود تباين مرتفع يُمثل نحو (٢٥٪) أو (٣٠٪) من قيمتها المتوسطة، ومن ثم فإن التقلبات من شهر إلى شهر يصعب فهمها.

يمكن التعبير عن الإحصائيات المستخدمة في القطاع الصناعي بدلالة:

#### - الطلبيات Commandes:

على الرغم من أن إجمالي الطلبيات يمثل نظرياً الطلب من سلعة ما، فإنه في مجال السلع الصناعية تكون تلك الطلبيات أحياناً بعيدة عن الاحتياج الحقيقي للزبون والمرتبطة بدورة الإنتاج، وذلك إما لأسباب تضاربية (خشية الزبون من ارتفاع في

الأسعار أو فقدان السلع من السوق) أو لأسباب تتعلق بتوقعات الموردين للمهل الزمنية. بالإضافة إلى ذلك، يتميز الكثير من الأسواق الصناعية بعدد محدود من المشترين أو بوجود بضعة مشترين كبار يمثلون الجزء الأساس من الطلب (الوكلاء المعتمدين بالنسبة للسيارات على سبيل المثال). ومن ثم يكفى لواحد من هؤلاء التجار أن يجرى طلبية كبيرة في نهاية شهر إلى بداية آخر كي يؤدي ذلك إلى خلق تقلبات قوية في السوق.

#### - تسليم البضاعة Livraisons:

غالباً ما تسعى المنشآت إلى الاستعانة بمعطيات تسليم (توصيل) البضاعة للتنبؤ بحجم المبيعات، وذلك لأن المعلومات المتعلقة بذلك يمكن الحصول عليها بسهولة من واقع أن هذا الأمر يتعلق بموضوع الفوترة (وضع الفاتورة). ولكن عملية تسليم البضاعة تعاني من سلبية أساسية تتمثل في كونها خاضعة لحركة الانقطاعات في المخزون، ومن ثم عدم تمثيلها للطلب الحقيقي. يضاف إلى ذلك، أنه في المجال الصناعي تمثل عمليات تسليم البضاعة مشكلة تتعلق بالفترة الزمنية القصيرة المتاحة أمام إدارة التنبؤ لتخطيط الإنتاج، فالذي يتنبأ بالطلبات لـ (٦) أشهر يمكنه تخطيط إنتاجه للفترة نفسها، في حين أن الذي يتنبأ بتسليم البضاعة في (٦) أشهر ودورة التصنيع عنده هي شهران<sup>(١)</sup> لن يكون لديه إلا (٤) أشهر لتخطيط إنتاجه.

في جميع الأحوال، يكون من المفضل التعامل مع المعطيات المقاسة حسب الحجم (وليس تبعاً لرقم الأعمال) وهذا يجنب المنشأة مشاكل الانكماش<sup>(٢)</sup> (déflatage)، وجميع المشاكل المتعلقة بالتفريق بين تأثير التغير في أحجام المبيعات وبين تأثير السعر النسبي (هذا الأخير يمثل التقلب في سعر سلعة صناعية ما مقارنة بالارتفاع العام للأسعار).

#### ١-٢- أنماط السلع الصناعية وقابلية التنبؤ:

تقسم السلع الصناعية إلى فئتين أساسيتين: فئة السلع الوسيطة مثل الفولاذ، الأسمنت، الزجاج، مواد البناء وفئة سلع التجهيزات مثل الأدوات الميكانيكية الكهربائية وتجهيزات الرافعات وتفريغ البضائع.

تعتبر السلع الوسيطة الأكثر مناسبة لإجراء التنبؤ على المواد الصناعية، وذلك كونها تتميز بخاصية أكثر قابلية للتنبؤ من السلع الصناعية الأخرى. فهي شديدة التجانس يمكن مقارنة منتجاتها من شركة إلى أخرى ويُعبّر عنها بواحدات الحجم.

(١) شرط أن تعمل المنشأة وفقاً للطلبات، وهذا ليس الحال بالنسبة لكل المنشآت الصناعية.

(٢) نغنى بالانكماش أن نسحب من سلسلة ما معبراً عنها برقم الأعمال تأثير الارتفاع العام بالأسعار.

فى حين يعتبر التنبؤ بسلع التجهيزات صعباً وحتى مستحيلاً عندما يتعلق الأمر بالتصنيع وفقاً لمخطط ما حيث تتنوع المنتجات بشكل كبير، ولن تكون متجانسة لا بالوحدات ولا بأرقام المبيعات<sup>(١)</sup>. بالإضافة إلى ذلك غالباً ما ترتبط هذه السلع ببرامج استثمارية حكومية أو بالاستثمارات الكبيرة لبعض المنشآت الخاصة المرتبطة بقرارات سياسية أو بظواهر اقتصادية على المستوى الأوروبى أو الدولى. فى هذه الحالات يتم استخدام طرائق تنبؤ مناسبة للقطاعات الاقتصادية الكلية مختلفة عن الطرائق الكمية القصيرة والمتوسطة الأجل.

بالمقابل، قد يحصل أن بعض سلع التجهيزات تكون متجانسة نسبياً، ومن ثم يمكن استخدام الطرائق الكمية للتنبؤ. ومثال ذلك الرافعات الهيدروليكية والضواغط الهوائية (الكومبريسير) المستخدمة فى الأشغال العامة.

لكى نستطيع القيام بإجراء تطبيق تنبؤى، فإننا بحاجة إلى المئات من الوحدات المباعة كحد أدنى.

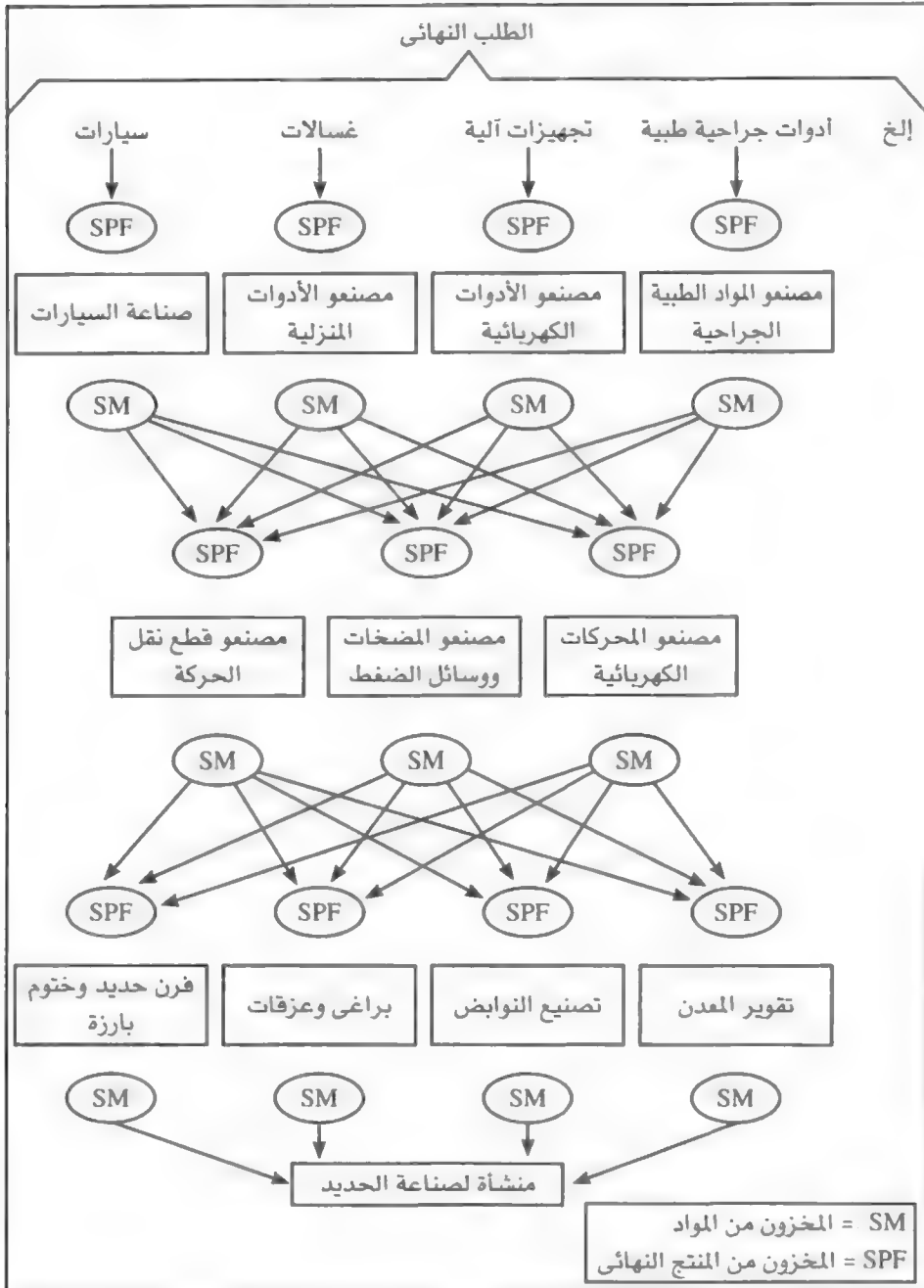
### ١-٣- مبدأ القطاع الأعلى (الأساس):

يختلف التطور الزمنى للاستهلاك النهائى من السلع الصناعية الوسيطة عن التطور الزمنى لسلع التجهيزات. فمن أجل السلع الصناعية الوسيطة، يبين الرسم التوضيحي (١) الدورة الصناعية التى تتم عبرها التقلبات فى الطلب النهائى (استهلاك العائلات واستثمار المؤسسات). فكل زيادة فى الطلب يمكن إشباعها من خلال السحب من المخزونات المتوافرة من المنتج النهائى، وفى حال عدم كفايتها فإن صانعى القطاعات النهائية، كصناعة السيارات على سبيل المثال، سيزيدون إنتاجهم، ومن أجل ذلك سيسعون إلى السحب أيضاً من مخزوناتهم من المواد (أى مجموعة المنتجات الصناعية المشتراة من خارج المنشأة). وفى حال عدم كفاية هذه الأخيرة، سيجرون طلبات إضافية من القطاعات التحويلية التى تزودهم بمكونات المنتج النهائى على شكل قطع منفصلة كمحولات الحركة وعلب السرعة فى مثال صناعة السيارات. وسيتم تنفيذ مصنعو القطع المنفصلة مجدداً معظم مخزوناتهم من المنتجات النهائية قبل أن يسعوا إلى زيادة محتملة فى طلباتهم من المنتج الأساس. وهكذا فإنه يتم فى النهاية تحويل التقلبات فى الطلب النهائى إلى مصنعى السلع الصناعية الوسيطة كالفولاذ وغيرها.

(١) يشار إلى أن بعض سلع التجهيزات يتم تصنيعها وفقاً للطلب، ومن ثم لا يوجد مخزون مما يجعل إجراء التنبؤ بدون فائدة.



الرسم التوضيحي رقم (١) الدورة الصناعية وتوزيع الطلب



يتضح مما سبق أن لمنطق القطاع الأعلى أو الأساس نتيجتين اثنتين:

- ارتباط الطلب على السلع الوسيطة (الفولاذ على سبيل المثال) بتغيرات مكونات الطلب النهائي المختلفة لصناعة السيارات وللتجهيزات العائلية ولصناعة المساكن وللاستثمارات الصناعية في الآلات.

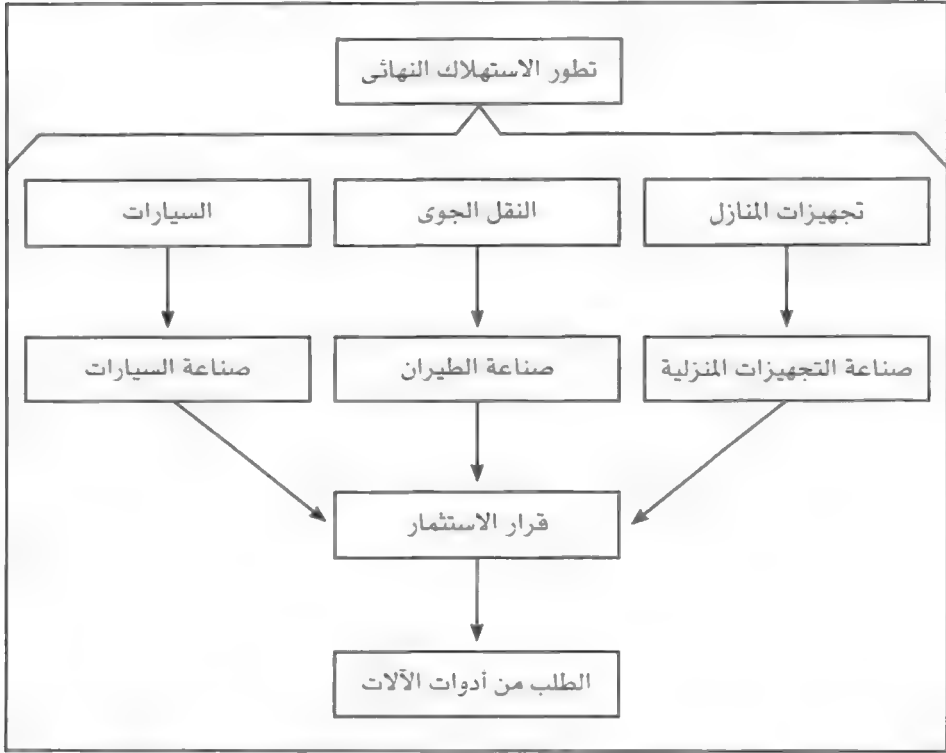
- بسبب وجود عدة مراحل للتحويل بين السلع الصناعية الوسيطة والمنتج المخصص للاستهلاك النهائي، فإن ذلك ينتج عنه تأخير زمني في التأثير المتبادل بين المنتجين، وهذا التأخير يكون كبيراً كلما كثر المخزون من المنتج النهائي ومن المواد الأولية الأخرى في كل مرحلة من مراحل التحويل. فبين وجود تغيير معنوي في الطلب على نوع محدد من السيارات وبين انعكاس ذلك على الطلب من الفولاذ عدة أشهر.

أما من أجل سلع التجهيزات، يبين الرسم التوضيحي (٢) التأثير لتطور الطلب النهائي من هذه السلع على الإنتاج من أدوات الآلات (Machines - outils). فالنمو في بعض الحاجيات النهائية، النقل الجوي والبري، تجهيزات المنازل، ... إلخ يُترجم بزيادة في الطلب على القطاعات الصناعية الموافقة مثل صناعات السيارات والطائرات ومصنّعي التجهيزات المنزلية الكهربائية، ... إلخ. وإذا لم تستطع هذه الصناعات بإمكانياتها الحالية من مواجهة هذه الزيادة غير المؤقتة فإنها تقرر الاستثمار في صناعة أدوات الآلات. وبموجب مبدأ التسارع الاقتصادي، فإن الزيادة أو الانخفاض في الطلب على سلع أدوات الآلات هي أكثر نسبياً من تطور الطلب النهائي.

يظهر مما سبق وجود حساسية قوية جداً في صناعات سلع التجهيزات للحالة الاقتصادية في قطاعات عدة (الطيران، أدوات الآلات، تجهيزات الرفع، ...)، وليس من النادر أن تشهد الطلبات تغيرات كبيرة من عام إلى آخر.

وكما هو الحال بالنسبة للسلع الصناعية الوسيطة، هناك مبدأ القطاع الرائد أو الأعلى، فالطلب على أدوات الآلات يرتبط بتطور الاستهلاك النهائي، وهذا التأثير الترابطي الزمني يكون أيضاً تأخيراً، والزيادة في الطلب النهائي يجب أن تكون مؤكدة حتى يتخذ المستثمرون قرارات الاستثمار.

الرسم التوضيحي رقم (٢) الاستهلاك النهائي وطلب سلع التجهيزات



## ٢- النموذج ذو المؤشرات التقديمية Le modèle à indicateurs en avance

يعتبر اللجوء إلى هذا النوع من النماذج "leading indicators" لإجراء التنبؤ قديم نسبياً<sup>(١)</sup> ويعود إلى العام ١٩٦٤. حيث سعى القائلون على التنبؤ إلى الحصول على مؤشر مميز يستطيعون من خلاله وضع كل ثقتهم به. ومن أجل ذلك تم تطوير نموذج يتضمن توفيقاً من المؤشرات ذات تأخيرات زمنية متعددة.

ومن خلال ما تم عرضه سابقاً، فإن التقلبات في الطلب النهائي تمر عبر الدورة الصناعية بمراحلها المختلفة، ومن ثم تصبح الطلبيات، في المثال المتعلق بالفولاذ، تابعة لمخزونات المفاوضين ولإنتاج بعض سلع التجهيزات، ... إلخ.

(١) ١٩٦٤ (Shiskin).

الهدف هنا هو فى محاولة توضيح الآليات التى تدير هذا التطور، لذلك فإننا سنتعرف على خصائص العلاقة بين المتغيرات المختلفة من خلال وضعها على شكل نموذج تأخير زمنى<sup>(١)</sup>:

$$y_t = f(x_{1,t-\theta_1}, x_{2,t-\theta_2}, x_{3,t-\theta_3}, \dots)$$

حيث تمثل  $\theta_i$  التأخيرات الزمنية بين كل من المتغيرات  $x_{i,t}$  والسلسلة  $y_t$ . يمكننا اعتبار هذه العلاقة خطية مع احتفاظنا دائماً بإمكانية إجراء تحويل ما على المعطيات كالتحويل اللوغاريتمى أو الأسى أو أخذ الفروقات الأولية.

$$y_t = a_1 x_{1,t-\theta_1} + a_2 x_{2,t-\theta_2} + a_3 x_{3,t-\theta_3} + \dots + a_k x_{k,t-\theta_k} + a_0$$

يعتبر النموذج الأخير من النماذج التى أصبحت معروفة بالنسبة لنا (انظر الفصل الرابع) ويتضمن بعض الفرضيات القوية الواجب التحقق منها واختبارها.

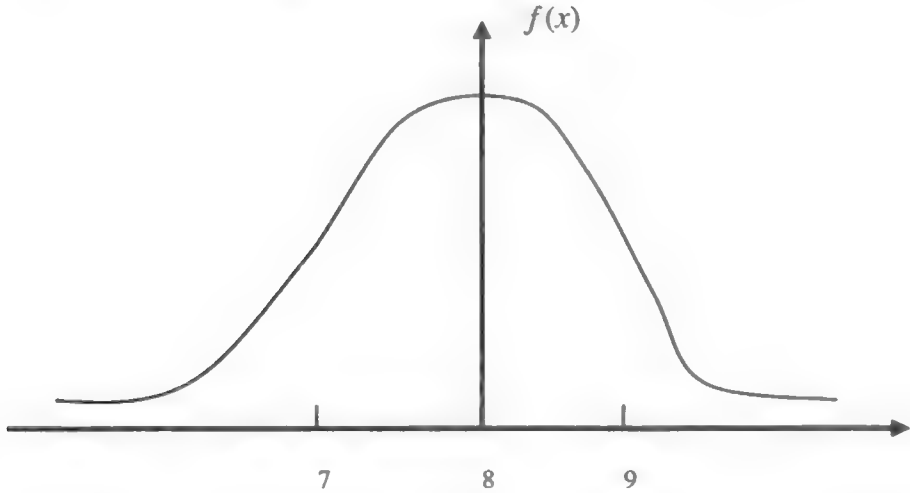
- ثبات الانزياحات (التأخيرات) الزمنية:

نفترض هنا أن التأخير الزمنى المتوسط ثابت بين إشارة المؤشر المستخدم (المتغير المستقل) وبين تأثيره فى المبيعات من السلع الوسيطة. ففى الواقع، إذا كان التأخير الزمنى مساوياً بالمتوسط ثمانية أشهر فذلك يعنى، وفقاً لقانون غوص Gauss الذى تخضع له التأخيرات، أن هناك احتمالاً فى (٩٥%) من الحالات أن قيمة التأخير ستكون محصورة ما بين (٧ إلى ٩) أشهر (الرسم التوضيحي ٣). وهذا يعنى أن القيمة الأكثر احتمالاً هى ثمانية أشهر واختيار هذه القيمة مرتبط بانحراف معيارى ما.

قد يكون لمؤشر ما تأخير زمنى غير ثابت، وهذا ما يحصل عندما يكون لمؤشر ما تأخير زمنى مختلف فى فترة الثبات للحالة الاقتصادية عن فترة إعادة النشاط الاقتصادى. إذن هناك مرحلة مهمة فى عملية البحث عن النموذج تتضمن اختبار صلاحية فرضية الثبات المتوسط للتأخيرات الزمنية.

(١) سنرى أن هذا النموذج من التأخير الزمنى مستخدم أيضاً فى مجال المنتجات الاستهلاكية المعمرة أو منتجات الاستهلاك الكبير بهدف أخذ متغيرات الدعاية والإعلان ذات التأثير غير اللحظى فى الاعتبار.

## الرسم التوضيحي رقم (٣) خضوع التأخير الزمني لقانون غوص الاحتمالي



## - استقلالية المتغيرات التفسيرية:

نفترض كذلك أن كل مؤشر (متغير تفسيري) لديه قدرة تفسيرية، في شرح التقلبات في المبيعات، مستقلة عن باقي المتغيرات أو المؤشرات التفسيرية الأخرى. فجميع المتغيرات، حتى لو كانت من نمط مختلف (مؤشرات الإنتاج أو استطلاعات الرأي حول الواقع الاقتصادي) أو ممثلة لقطاعات متنوعة (سيارات، كيمياء، سكن) ليست مستقلة لا اقتصادياً ولا إحصائياً. فهي من جهة تخضع بمجملها للحالة الاقتصادية العامة ومن جهة أخرى ترتبط فيما بينها بعلاقات قوية. فالسلع تلعب دوراً تحكيمياً في تحديد أشكال الإنفاق العائلي، ومثال ذلك سلعتا السيارات والسكن المرتبطتان أحياناً معاً؛ إذ يمكن اعتبار شراء السيارة عملاً بديلاً لمبلغ غير كافٍ لشراء أو اقتناء منزل.

إذن لا يمكن للمتغيرات التفسيرية المستخدمة أن تكون مستقلة، وهذا يُعبر عنه إحصائياً من خلال الارتباط الكبير بين المتغيرات التفسيرية. وهنا لا بد من الإشارة إلى ظاهرة تسمى بـ "multicollinéarité" أي الارتباط الكبير بين المتغيرات التفسيرية التي غالباً ما نصادفها عند البحث عن النموذج المناسب مما يوحى بوجود علاقات تفسيرية هي في حقيقتها وهمية وتعود ربما إلى تعريف غير صحيح للنموذج.

وكما هو الحال بالنسبة لاختيار التأخيرات الزمنية، فإن البحث عن المتغيرات التفسيرية يعتبر من المسائل المهمة التي تشغل اهتمام القائم على التنبؤ.

- ثبات حصة السوق:

إذا كان المتغير الواجب تفسيره مكوناً من مبيعات المنشأة وكانت المتغيرات التفسيرية هى مؤشرات السوق، فإننا نفترض ثبات حصة السوق. فالبحث عن علاقة ثابتة خلال عدة سنوات بين مبيعات المنشأة وبين مؤشرات السوق يقتضى عدم وجود تعديلات جوهرية فى حصة السوق للمنشأة.

- صلاحية النموذج على إجمالى الفترة الزمنية:

نظرياً يُفترض فى النموذج المستخدم أن يكون صالحاً على إجمالى الفترة الزمنية وكذلك الحال بالنسبة للمعاملات المقدرة للنموذج، ولكن الأوزان النسبية لكل متغير تفسيري يمكن أن تتغير مع مرور الزمن (ومع الحالة الاقتصادية)، ولذلك سيكون مفيداً تقدير النموذج على فترات منزلة (ثلاث إلى أربع سنوات)، وذلك بغية أخذ التقلبات الحاصلة بفاعلية كبيرة بعين الاعتبار.

- استناد النموذج إلى معادلة واحدة:

يمكننا استخدام نموذج المعادلات الآتية حيث ندخل عدة متغيرات تابعة فى النموذج، فعلى سبيل المثال يمكن اعتبار حجم المبيعات متغيراً تابعاً أول ( $y_1$ ) وأسعار المبيعات متغيراً تابعاً ثانياً ( $y_2$ ) والمخزون متغيراً تابعاً ثالثاً ( $y_3$ ). يمكن التعبير عن العلاقة بين المتغيرات التابعة وبين المتغيرات المستقلة على النحو التالى:

$$y_1 = f(y_2, y_3, x_1, x_2, x_3, \dots)$$

$$y_2 = g(y_1, y_3, x_1, x_2, x_3, \dots)$$

$$y_3 = h(y_1, y_2, x_1, x_2, x_3, \dots)$$

على الرغم من دراسة هذه النماذج دراسة تفصيلية نظرية إلا أن وضعها موضع التنفيذ عملياً يبقى صعباً. وتستخدم هذه النماذج فى القطاعات الاقتصادية الكلية ويرمز لها بالرمز VAR (Vector Auto Regressive) ويتم تقديرها للمعطيات السنوية أو الفصلية، أما بالنسبة للمعطيات الشهرية حيث يجب البحث عن التأخيرات الزمنية، فإن هذه النماذج تصبح صعبة جداً. وعلى الرغم من الجهود الكبيرة المتعلقة بوضع هذه الطريقة موضع التنفيذ، فإن التحسن الحاصل فى جودة التنبؤ يبقى محدوداً مقارنة بما بذل من جهود لاستخدام هذه الطريقة.

## - العلاقة بين المتغيرات هي علاقة خطية:

يتم عادة صياغة النماذج وفقاً للشكل الخطى بين المتغير التابع والمتغيرات المستقلة، وذلك بسبب صعوبة التقدير للنماذج غير الخطية، وفى حال لم يكن النموذج خطياً فيمكن جعله خطياً.

يمكن الاستعانة ببعض التحويلات للمتغيرات مما يجعل النموذج خطياً، فعلى سبيل المثال النموذج التالى  $y_t = x_{1t}^{a_1} x_{2t}^{a_2} x_{3t}^{a_3} a_0$  حيث تمثل المعاملات  $a_1$ ،  $a_2$  و  $a_3$  المرونات<sup>(١)</sup>، يمكن إعادته للشكل الخطى من خلال إجراء تحويل على المتغيرات على النحو التالى:

$$\text{Log}(y_t) = \text{Log} x_{1t}^{a_1} x_{2t}^{a_2} x_{3t}^{a_3} a_0$$

أو

$$\text{Log}(y_t) = a_1 \text{Log}(x_{1t}) + a_2 \text{Log}(x_{2t}) + a_3 \text{Log}(x_{3t}) + \text{Log}(a_0)$$

ومن ثم يمكننا باستخدام طرائق التقدير الاعتيادية المعروضة فى الفصل الرابع تقدير المعاملات السابقة للشكل الأخير للنموذج.

## ٣- العوامل (المتغيرات) التفسيرية:

هناك العديد من العوامل التفسيرية التى يمكن استخدامها فى مجال السلع الصناعية، نذكر منها:

- مؤشرات الإنتاج للقطاعات النهائية الاستهلاكية.
- مؤشرات الأسعار.
- معدلات الفائدة.
- مؤشرات أسعار السوق المالى.
- استطلاعات الرأى حول الوضع الاقتصادى المتعلق بالإنتاج المتوقع أو بقائمة الطلبيات أو مستوى المخزون التى تكون متوافرة بدقة.
- الإحصائيات حول مستوى البطالة.
- عجز المنشآت، الإفلاس وصعوبات التمويل.

(١) تمثل المرونة معدل التزايد النسبى. فإذا كان  $x_1$  السعر لمنتج ما و  $y$  حجم الطلب، فإن المعامل  $a_1$  يمثل معامل التغير النسبى للطلب المرتبط بارتفاع أو انخفاض الأسعار.

- معطيات المديونية: معدلات الفائدة، إحصائيات الاستدانة على المدى القصير والمتوسط والطويل لجميع قطاعات الأنشطة.
- إحصائيات أرقام الأعمال لجميع الأشكال التجارية.
- إحصاءات البناء: موافقة السكن، مساكن فى طور البناء، مساكن منتهية، ...
- المخزون الموجود عند الموزعين المختصين.
- إلخ.

العديد من المؤشرات لا يمكن استخدامها مباشرة فى النموذج المستخدم وتستلزم إجراء تحويلات عليها.

فهو مؤشر الإنتاج غالباً ما يكون غير مستقر فهو يتأثر بحركة اتجاه عام صاعدة أو هابطة، ومن ثم لا بد من إجراء تحويل عليه لى يصبح مستقراً. التحويل الأكثر استخداماً فى هذه الحالة يقتضى أخذ الفروقات الأولية لهذا المؤشر، ومن ثم جعل السلسلة الممثلة له أكثر حساسية للزيادات الشهرية من خلال حذفها للجمود المرتبط بالمستوى المطلق للنشاط. فإذا كانت  $x_t$  تمثل مؤشر الإنتاج، فإن التغير المحول يصبح  $x_t - x_{t-1}$  أو  $(x_t - x_{t-1})/x_{t-1}$ . يسمح هذا التحويل الأخير بتأكيد الاستقرار بالمعنى المتوسط. يمكن تطبيق التحويل نفسه على سلاسل الأسعار حيث يكون تفاعل الزبائن مرتبطاً بتغيرات الأسعار (ارتفاع التعرفة) وليس بمستواها المطلق.

هناك نوع آخر من التحويلات التقليدية ويسمى بتحويل الانكماش  $déflatage$  يقضى بتقسيم مجموعة القيم لسلسلة ما على القيم الموافقة لمؤشر السعر المناسب. فكل السلاسل المعبر عنها بالعملة المحلية الجارية (إحصائيات المديونية، أرقام الأعمال، ..) يجب تحويلها بحيث تصبح قابلة للمقارنة زمنياً مع جميع النقاط المكونة للسلسلة.

النوع الثالث من التحويلات الممكن إجراؤها على السلسلة الزمنية هو استخدام الفلتر مثل فلتر الوسط المتحرك<sup>(١)</sup> وذلك بغية حذف التقلبات العشوائية. وهكذا فإن بعض الاستقصاءات عن الحالة الاقتصادية تكون خاضعة إلى تقلبات شديدة نتيجة كون إجابات الصناعيين خاضعة لأرقام مبيعاتهم، فإذا وجد فى بعض القطاعات ثلاث أو أربع منشآت تحتكر إجمالى رقم المبيعات فى المهنة، فيكفى لمجيب واحد منهم متفائل أو متشائم ليوم ما أن يغير بشكل كبير نتائج الاستقصاء. لذلك فإن استخدام فلتر الوسط المتحرك يصقل هذه التقلبات الكبيرة بحيث تصبح أكثر معنوية.



أخيراً لا بد من الإشارة إلى ضرورة تصحيح كل السلاسل الإحصائية التى فيها حركة فصلية، وذلك تجنباً لخطر إخفاء علاقة حقيقية بين المبيعات والمؤشرات المستقلة التفسيرية المستخدمة.

#### ٤- التنبؤ فى مجال الصناعات الحديدية:

##### ٤-١- عرض المشكلة:

يتعلق مثالنا الأول بالتنبؤ بالاستهلاك الفرنسى من الفولاذ المقاوم للصدأ على مستوى الاستهلاك المحقق<sup>(١)</sup> فى فرنسا، وليس على مستوى منشأة محددة.

نختار فى المرحلة الأولى المتغيرات التفسيرية أو المؤشرات ذات العلاقة الاقتصادية مع السلسلة المراد التنبؤ بقيمتها. ومما لا شك فيه أن عملية انتقاء المؤشرات التفسيرية تعتبر نقطة أساسية من أجل الحصول على تنبؤات جيدة، وقد يؤدى انتقاء متغيرات تفسيرية بعيدة عن مجال المتغير المراد التنبؤ به إلى تنبؤات وهمية غير صحيحة.

على سبيل المثال يمكن لمؤشر إنتاج الجبس، مع تأخير زمنى  $\theta$  شهراً، أن يكون ذا علاقة جيدة مع الطلبات من الفولاذ خلال سنتين أو ثلاث سنوات، ومع افتراض أن شهر تموز من العام A يتميز بإنتاج كبير من الجبس فإنه فى حال استخدام مؤشر إنتاج الجبس متغيراً تفسيرياً للتنبؤ باستهلاك الفولاذ، فإننا سنحصل على رقم غير معقول للتنبؤ باستهلاك الفولاذ للشهر الموافق لتموز من العام  $A + \theta$  شهراً.

إذن لا بد من أن يكون للمؤشرات التفسيرية المقترحة معنى اقتصادى يتوافق مع المتغير المراد تفسيره والتنبؤ به.

بعد تحديد هذه المؤشرات نعمل على تقليصها من خلال انتقاء الأكثر صلة منها بالمتغير التابع، ومن ثم نختار التأخيرات الزمنية المرتبطة بكل منها.

بعد ذلك نلجأ إلى طرائق التقدير المستخدمة لتقدير المعاملات للنموذج المنتقى، وهذه الخطوة تعطينا بعض المؤشرات حول الجودة الإحصائية للنموذج المستخدم كمعامل التحديد ومؤشرات ستيودنت الدالة على درجة التشتت للمعاملات، ومن ثم المعنوية الإحصائية للمتغيرات، وكذلك نحصل على اختبار داربين واتسون.

(١) الاستهلاك المحقق = الإنتاج + الاستيراد - التصدير.

في حال تبين أن النموذج المقدر ليس صالحاً إحصائياً فإننا نعود إلى المرحلة السابقة ونبحث عن متغيرات تفسيرية بديلة. أما إذا ثبتت الصلاحية الإحصائية فإننا نستمر في اختبارنا للصلاحية الاقتصادية للنموذج، فقد يكون النموذج مناسباً إحصائياً إلا أن قيم المعالم المقدرة للنموذج تكون غير معقولة من وجهة النظر الاقتصادية.

بعد الانتهاء من التحقق من الصلاحية الإحصائية والاقتصادية للنموذج نقوم بإجراء عملية محاكاة للنموذج المختار للحصول على تنبؤات «بيضاء» تسمح فقط باختبار الجودة التنبؤية للنموذج. فإذا كانت هذه التنبؤات التجريبية معقولة من خلال مقارنتها مع القيم الحقيقية للمتغير المراد التنبؤ به فإننا نعتمد النموذج المقدر ونستخدمه لإجراء التنبؤات المطلوبة.

#### ٤-٢- الانتقاء الآلي للمتغيرات التفسيرية وللتأخيرات الزمنية:

لوضع الآلية السابقة موضع التنفيذ على معطيات المثال المتعلق بإيجاد النموذج المناسب للاستهلاك الفرنسي من الفولاذ المقاوم للصدأ، فإننا نستخدم المؤشرات المقترحة<sup>(١)</sup> المتوقع أن تمثل جميع مكونات الطلب على الفولاذ وذات التأثير في الحالة العامة لقطاع الفولاذ. وهذه المؤشرات هي:

- ١- مؤشر الإنتاج CVS (المصحح من التقلبات الفصلية) لفرع صناعة السيارات.
  - ٢- مؤشر الإنتاج CVS (المصحح من التقلبات الفصلية) لفرع الصناعات الكيماوية والكاوتشوك.
  - ٣- مؤشر الإنتاج CVS (المصحح من التقلبات الفصلية) للتحويل الأولي للفولاذ.
  - ٤- المؤشر الفرنسي لأسعار الجملة للمنتجات الحديدية.
  - ٥- رأى مصنعى التجهيزات المنزلية فى المخزون المتوافر لديهم.
- تم إجراء التحليل لمدة أربع سنوات لمعطيات شهرية من كانون الثانى من العام A إلى كانون الأول من العام A + 4. تم تصحيح جميع السلاسل المستخدمة من التقلبات الفصلية كما تم تقليص déflaté مؤشر أسعار الجملة للمنتجات المعدنية بواسطة المؤشر العام للأسعار.

(١) يمكننا عملياً انتقاء عدد أكبر من المتغيرات التفسيرية، إلا أننا اقتصرنا على دراسة خمسة فقط للتبسيط.

بعد ذلك نكون بصدد اختيار المؤشرات الأقل ترابطاً فيما بينها والأكثر ارتباطاً بمؤشر الاستهلاك من الفولاذ، ومن ثم نكون بصدد تحديد هذه المؤشرات واختيار درجات التأخير الزمني.

نفترض أن كل مؤشر (متغير تفسيري) يؤثر في الاستهلاك من الفولاذ بتأخير زمني محصور بين (٦ إلى ١٢) شهراً.

نستخدم إذن إحدى طرائق الانتقاء الآلى للمتغيرات التفسيرية الأكثر مناسبة. وفي حالتنا هذه يكون لدينا عدد كبير من المتغيرات التفسيرية (٥ مؤشرات  $\times$  ٧ تأخيرات = ٣٥) وذلك لأن كل مؤشر من المؤشرات الخمسة سيتفرع عنه سبعة متغيرات تفسيرية (متغير تفسيري جديد لكل تأخير زمني). لذلك فسوف نستخدم طريقة الانحدار بالمرحل التي تبدو الأكثر كفاءة في انتقاء المتغيرات ذات الإسهام النسبي الأكبر في تقلبات استهلاك الفولاذ (الفصل الرابع).

النتائج للمراحل المختلفة لهذه الطريقة معروضة في الجداول اللاحقة. تمثل الأسطر في الجداول (من ١ إلى ٣) التأخيرات الزمنية (من ٦ إلى ١٢) وتمثل الأعمدة المتغيرات التفسيرية (من ١ إلى ٥). كل خانة من الجداول المشار إليها تمثل معامل الارتباط البسيط بين الاستهلاك من الفولاذ الفرنسي المقاوم للصدأ  $y_t$  ومؤشر ما  $x_{i,t}$  لتأخير زمني معطى  $\theta$  ( $x_{i,t-\theta}$ ). ومن ثم ففي الجدول (١) مثلاً نلاحظ وجود معامل الارتباط الأكبر بالقيمة المطلقة (0.826 -) في تقاطع العمود (٦) والسطر (١) (التأخير يساوي ٦ والمؤشر هو  $x_{5,t}$ ). إذن سيتم اعتبار السلسلة «رأى مصنعى التجهيزات المنزلية في المخزون المتوافر لديهم» مع التأخير المساوى لـ (٦) أشهر.

الجدول رقم (١) تحليل الارتباط في المرحلة (١)

المتغير التفسيري التأخير	$x_{1,t}$	$x_{2,t}$	$x_{3,t}$	$x_{4,t}$	$x_{5,t}$
٦	٠,٥٧٧	٠,٦٨٣	٠,٨١١	٠,٣٨٩	٠,٨٢٦-
٧	٠,٦٠٨	٠,٥٥٦	٠,٦٩٦	٠,٢٧٢	٠,٧٩٣-
٨	٠,٧١٧	٠,٤٦٤	٠,٦٠١	٠,١٤٢	٠,٧٤٤-
٩	٠,٥٩٣	٠,٢٤٧	٠,٤٤٠	٠,٠٢٥-	٠,٦٥٥-
١٠	٠,٧١٩	٠,١١٤	٠,٣١٩	٠,١٤٥-	٠,٥٣٥-
١١	٠,٥٩٣	٠,٠٣٤-	٠,٠٨٢	٠,٢٧٩-	٠,٣٩٠-
١٢	٠,٥٢٤	٠,١٧٧-	٠,٠٣٣-	٠,٣٩٧-	٠,٢٦٨-

نجرى أول انحدار:  $y_t = \hat{a}_1 x_{5,t-6} + \hat{a}_0 + e_{1,t}$

يمثل الباقي  $e_{1,t}$  سلسلة الاستهلاك من الفولاذ المصفاة من تأثير المتغير «رأى مصنعى التجهيزات المنزلية فى المخزون المتوافر لديهم».

الجدول رقم (٢) تحليل الارتباط فى المرحلة (٢)

المتغير التفسيري التأخير	$x_{1,t}$	$x_{2,t}$	$x_{3,t}$	$x_{4,t}$	$x_{5,t}$
٦	٠,٢٦٥	٠,١١٥	٠,٢٢٧	٠,١٤٧	٠,٠٠٠
٧	٠,٢٧٠	٠,٠٣٤	٠,١٠٩	٠,٠٤٤	٠,٠٩٧-
٨	٠,٤٣٤	٠,٠١٢	٠,٠٠٧	٠,٠٨٩-	٠,٠٩٨-
٩	٠,٢٩٦	٠,٢١٨-	٠,٠٢٧-	٠,٢٧٥-	٠,٠٥٣-
١٠	٠,٤٦٩	٠,١٨٠-	٠,٠٠٨-	٠,٣٣٤-	٠,٠٢١-
١١	٠,٢٥٠	٠,٢١٠-	٠,٢٩٢-	٠,٤٣٦-	٠,٠٦٣
١٢	٠,٢٢٢	٠,٢٥٢-	٠,٣١٤-	٠,٥١٧-	٠,٠٨٣

فى المرحلة التالية (الجدول ٢)، نحسب كل معاملات الارتباط بين  $e_{1,t}$  والسلاسل التفسيرية الأخرى  $x_{i,t-\theta}$  ( $i = 1, 2, \dots, 5; \theta = 6, 7, \dots, 12$ ). نلاحظ أن معامل الارتباط بين  $e_{1,t}$  و  $x_{5,t-6}$  أصبح مساوياً للصفر فالسلسلة  $e_{1,t}$  لم تعد تحتوى على معلومات متعلقة بالمتغير  $x_{5,t-6}$ . وبأخذنا للمعامل الأكبر (٠,٥١٧) الموافق لمؤشر أسعار الجملة للمنتجات المعدنية بتأخير زمنى قدره (١٢) شهراً نكون انتقينا فى النموذج المستخدم المتغير ذا المعلومات الأكبر المتمم للمتغير السابق انتقاؤه. ومن ثم نجرى انحداراً جديداً:

$$y_t = \hat{a}_1 x_{5,t-6} + \hat{a}_2 x_{4,t-12} + \hat{a}_0 + e_{2,t}$$

نبحث من جديد فى جميع معاملات الارتباط بين  $e_{2,t}$  والسلاسل التفسيرية  $x_{i,t-\theta}$  ( $i = 1, 2, \dots, 5; \theta = 6, 7, \dots, 12$ ) عن المعامل الأكبر بالقيمة المطلقة.

المتغير التفسيري الثالث الواجب إدخاله فى النموذج (الجدول ٣) هو مؤشر الإنتاج فى صناعة السيارات وتأخير مساوٍ لـ (٨) أشهر (الارتباط يساوى إلى ٠,٤١٢). إذن نجرى انحداراً جديداً من الشكل:

$$y_t = \hat{a}_1 x_{5,t-6} + \hat{a}_2 x_{4,t-12} + \hat{a}_3 x_{1,t-8} + \hat{a}_0 + e_{3,t}$$

الجدول رقم (٣) تحليل الارتباط في المرحلة (٣)

المتغير التفسيري التأخير	$X_{1,t}$	$X_{2,t}$	$X_{3,t}$	$X_{4,t}$	$X_{5,t}$
٦	٠,٣٣٧	٠,١٠٦	٠,٢٦٣	٠,٢٦٨	٠,٠٠٠
٧	٠,٣٥٧	٠,١١١	٠,٢٠٧	٠,٢٠٧	٠,١٧٤-
٨	٠,٤١٢	٠,١٥٧	٠,٣٠٧	٠,٣٠٧	٠,٢٧٢-
٩	٠,٣٣٧	٠,٠٣١	٠,٢٤٤	٠,٢٤٤	٠,٢٥٤-
١٠	٠,٢٦٧	٠,١٧٢	٠,٣٣١	٠,٣٣١	٠,٢٩٣-
١١	٠,٢١٦	٠,١٨٨	٠,٠٥٢	٠,٠٥٢	٠,٢٦٨-
١٢	٠,١٨٢	٠,١٦٧	٠,٠٦١	٠,٠٦١	٠,٢٣٨-

نبحث من جديد في جميع معاملات الارتباط بين  $e_{3,t}$  والسلاسل التفسيرية  $x_{i,t-\theta}$  ( $i = 1, 2, \dots, 5; \theta = 6, 7, \dots, 12$ ) عن العامل الأكبر بالقيمة المطلقة.

لم يعد يظهر أى معامل ارتباط مختلف معنوياً عن القيمة صفر، ومن ثم نوقف عملية انتقاء المتغيرات التفسيرية.

#### ٤-٣- استخدام النموذج وإجراء التنبؤ:

النموذج المستخدم إذن هو التالى:

$$CFAI_t = 14,302_{(2.1)} - 98,27_{(3.9)} STEM_{t-6} - 4,05_{(7.4)} IPPM_{t-12} + 168,57_{(2.7)} AUTO_{t-8}$$

$$R^2 = 0.91$$

$$DW = 1.91$$

$$n = 36$$

$$(.) = \text{ratio de Student}$$

حيث:

CFAI تمثل الاستهلاك الفرنسى من الفولاذ المقاوم للصدأ.

STEM رأى مصنعى التجهيزات المنزلية فى المخزون المتوافر لديهم.

IPPM مؤشر أسعار الجملة للمنتجات الحديدية.

AUTO مؤشر الإنتاج CVS (المصحح من التقلبات الفصلية) لفرع صناعة السيارات.

يلاحظ أن عدد المشاهدات قد تم تقليصه إلى (٢٦) فقط: لأننا فقدنا (١٢) مشاهدة بسبب التأخير المساوئ لـ (١٢) شهراً.

تستدعى هذه النتائج بعض التعليق:

- يعتبر النموذج من وجهة النظر الإحصائية مناسباً حيث مؤشرات ستيودنت جميعها معنوية، وكذلك فإن مؤشر اختبار داربين واتسون لا يظهر أى ارتباط ذاتي للأخطاء.

- مجال التنبؤ يساوى (٦) وهذه القيمة تمثل الأقل بين التأخيرات الظاهرة في النموذج المقدّر (٦،١٢،٨).

- التفسير الاقتصادي إلى حد ما معقول للمتغيرين الأوليين. هناك تأثير إيجابي لإنتاج السيارات بتأخير قدره (٨) أشهر كما يوجد تأثير سلبي لمستوى المخزون لدى مصنعى التجهيزات العائلية بتأخير قدره (٦) أشهر، وكذلك لمؤشر السعر الإجمالى للمنتجات المعدنية عند (١٢) شهراً.

إذن يمكن حساب التنبؤ لمجال زمنى طوله ستة أشهر انطلاقاً من القيم المعروفة للمتغيرات التفسيرية الثلاثة. يمكننا عند اللزوم إضافة عوامل أخرى مثل حركة الاتجاه العام (تمديد خارجى على الزمن) والحركة الفصلية للأشهر المعنوية، وذلك بغية الحصول على تنبؤات عملية.

## ٥- التنبؤ في مجال الأجهزة الكهربائية:

### ٥-١- عرض المشكلة:

تعتبر المنتجات المصنعة والموزعة بواسطة شركات إنتاج الأجهزة الكهربائية (أجهزة التحكم فى المحركات ومفيرات السرعة والأزرار الكهربائية... إلخ) من المنتجات الصناعية ومن ثم تكون حساسة للتقلبات فى الحالة الاقتصادية العامة لسلع التجهيزات. يمكننا ملاحظة وجود سوقين لهذه المنتجات، سوق التجهيز الأولى المرتبط بالاستثمارات الجديدة وسوق التجديد لهذه المنتجات.

تعتبر الأجهزة الكهربائية وفقاً لأرقام تصنيفها كبيرة جداً (٨٠٠٠٠)، ولكن ما يخزن منها فقط (٦٠٠٠) (حيث مهلة التسليم أصغر من مهلة التصنيع). الأدوات الأخرى لا تخزن إلا من أجل غايات صناعية مثل التصنيع لكميات كبيرة أو لغايات تضاربية مثل تكوين المخزون فى فترة النقص فى التجهيزات.

يتم إجراء التنبؤ لكل مجموعة من المنتجات المتجانسة (Famille Produit (FP ولكل منتج من المنتجات Références stockées المخزنة المرتبطة بانحراف معيارى لخطأ التنبؤ. يبين الرسم التوضيحي (٤) آلية تنظيم المعطيات بهذا النوع من الأجهزة الكهربائية وقياس حجومها.

يشمل نشاط هذه الشركة جميع الدول وترتبط صادراتها بجميع أنحاء العالم. كما أن فرنسا تحتفظ وحدها بما يعادل تقريباً (٢٥٪) من رقم الأعمال لهذه الصناعة. وإذا أضفنا لهذه الحصة حصة بعض الدول الأوربية الأخرى (ألمانيا، إنجلترا، إيطاليا وإسبانيا) وحصة الولايات المتحدة لأصبح الإجمالى مساوياً (٩٠٪) من أرقام المبيعات.

تتم عمليات البيع نحو الخارج من خلال فروع مستقلة إدارياً للشركة الأم، ومن ثم فإن تحديد مستويات المخزون فى هذه الفروع يبقى رهناً بتقديرات الإدارات المحلية. هناك نظامان للتنبؤ بهذا النوع من السلع:

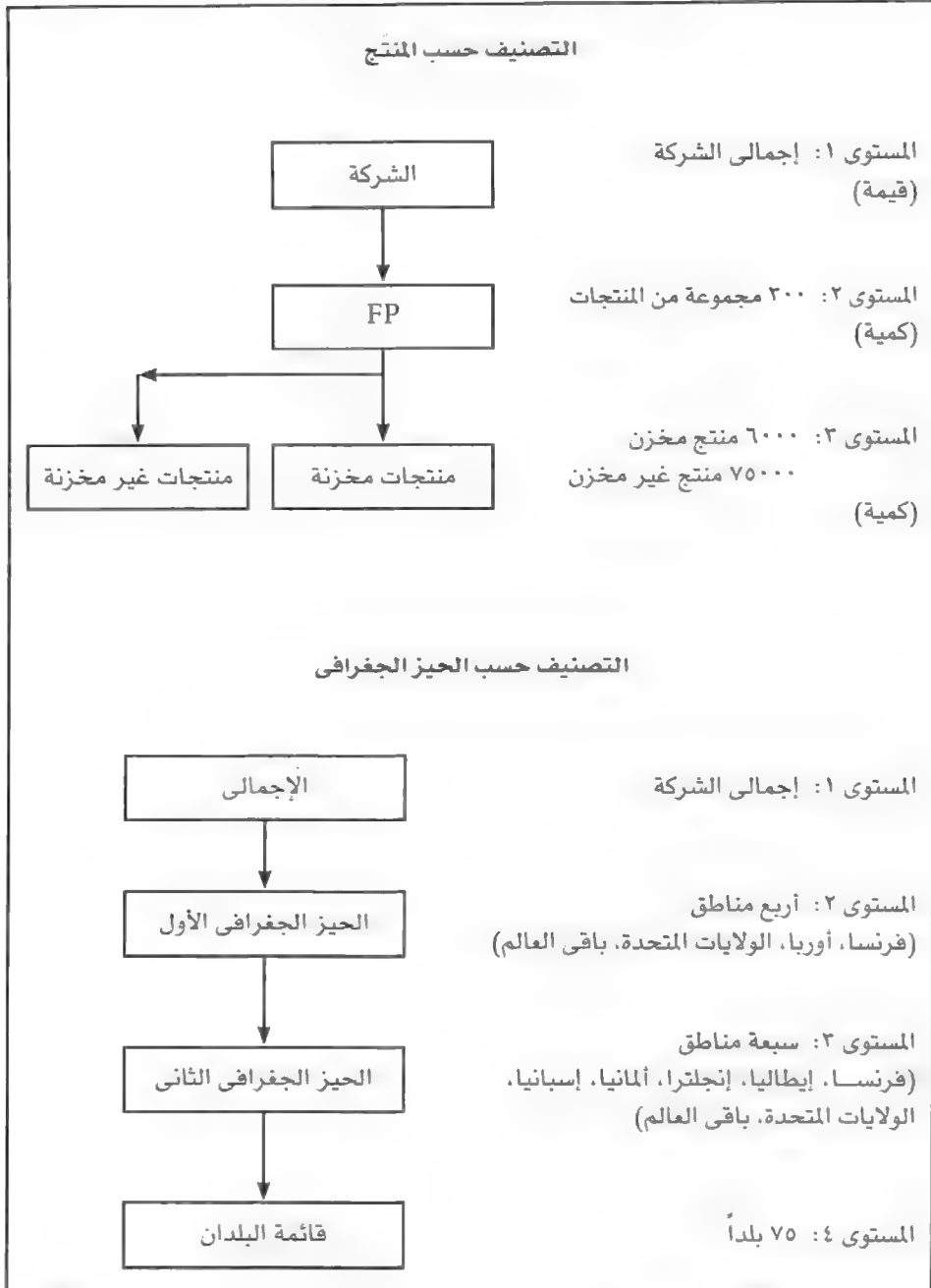
- واحد مخصص ومعد لفرنسا.
- والثانى معد للفروع المستقلة فى الخارج (المستوى ٣) وهو أكثر بساطة فى استخدامه بسبب ضعف المنافسات المحلية من جهة، وبسبب صعوبة الحصول على الإحصائيات المطلوبة فى البلدان الأجنبية من جهة أخرى.

## ٥-٢- طريقة التنبؤ لفرنسا:

### ٥-٢-١- إدخال الحالة الاقتصادية العامة:

يرتبط نشاط هذه الشركة بالبيئة الاقتصادية العامة، ومن ثم سيكون من المفيد محاولة تحديد المتغيرات التفسيرية المستقلة ذات العلاقة، ولا يمكن إدخال الحالة الاقتصادية العامة إلا على المستوى الإجمالى، أى على مستوى إجمالى الشركة فى فرنسا. والهدف هنا هو فى محاولة البحث بواسطة معاملات الارتباط عن المؤشرات التفسيرية التى يمكن من خلالها التنبؤ بالتقلبات فى الحالة الاقتصادية العامة. المعطيات المستخدمة هى معطيات فصلية، ومن ثم فإن تحليل التأخيرات الزمنية يتم من أجل أربع فترات على الأكثر (عام واحد).

الرسم التوضيحي رقم (٤) تنظيم المعطيات





النموذج المعروف للتنبؤ هو من النمط التالي:

$$\text{Log} (\text{ActFra}^{\text{CVS}})_t = a_1 x_{1,t-\theta_1} + a_2 x_{2,t-\theta_2} + \dots + a_k x_{k,t-\theta_k} + a_h t + a_0$$

حيث تمثل  $\theta_i$  التأخيرات الزمنية بين كل واحد من المؤشرات  $x_{i,t}$  المختبرة (استطلاع الرأي حول الوضع الاقتصادي، مؤشرات البناء، معدل الفائدة، ...) وبين سلسلة المبيعات المراد التنبؤ بها ( $\text{ActFra}^{\text{CVS}}$  (*Activité France Corrigée des Variations Saisonnières*)).

تمثل  $a_i$  معاملات التثقيل لكل واحدة من المتغيرات التفسيرية وهذه المعاملات تُحدد بواسطة الانحدار المتعدد. المتغير  $t$  يمثل التطور الطبيعي للمبيعات (مركبة الاتجاه العام أو النزعة).

باستخدام طريقة انتقاء المتغيرات التفسيرية نحصل على النموذج المقدر النهائي التالي:

$$\text{Log} (\text{ACTFRACVS}) = 3.62 + 0.061 \times \text{Trend} + 0.0087 \times \text{COLLECT} (-3) + 0.041 \times \text{ENCONJ} (-3)$$

حيث:

$\text{LOG} (\text{ACTFRACVS})$ : لوغاريتم النشاط الإجمالي الفرنسي المصحح من التقلبات الفصلية.  
**Trend**: نزعة خطية وتم إدخالها لمراعاة التطور الطبيعي للمبيعات في المنشأة  
 ( $\text{Trend} = 1, 2, 3, \dots$ )

**COLLECT (-3)**: عدد المباشرين بالسكن الجماعي بتأخير زمني قدره (٣) فترات (ثلاثة فصول).

**ENCONJ (-3)**: استقصاء الحالة الاقتصادية حول إمكانات الاستثمار بتأخير زمني قدره (٣) فترات (ثلاثة فصول).

بعد إعادة المركبة الفصلية، يمكننا من خلال هذا النموذج إجراء التنبؤ لمجال طوله ثلاثة فصول للنشاط الإجمالي على مستوى فرنسا.

#### ٥-٢-٢- التنبؤ على مستوى المجموعة المتجانسة من المنتجات:

إيجاد النموذج الاقتصادي القياسي (كما في الحالة السابقة) على مستوى كل مجموعة (٢٠٠ مجموعة) ليس واقعيًا للأسباب التالية:

- عدم توافر السلاسل الزمنية الطويلة لمعظم المجموعات.
- صعوبة إيجاد النماذج لكل المجموعات.

تقود هذه العناصر إلى إجراء التنبؤ على مستوى المجموعة بواسطة إحدى الطرائق ذات النمط الداخلي.

### - حساب المركبة الفصلية:

تشير التحاليل المختلفة إلى وجود مركبة فصلية صناعية كلاسيكية، أى وجود انخفاضات فى الأنشطة لشهرى آب وكانون الأول (انظر الشكل ١).

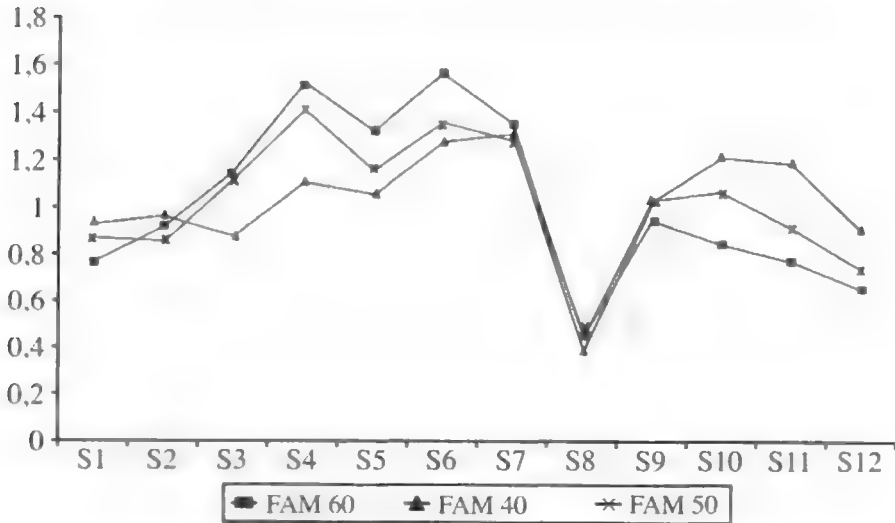
يمكن إذن حساب المعاملات الفصلية على مستوى المجموعة الواحدة (المستوى ٢ من التصنيف حسب المنتج). ويبدو أنه من المفضل حساب هذه المعاملات الفصلية ليس انطلاقاً من السلاسل الزمنية المأخوذة على مستوى أرقام المنتجات الفردية Références إنما على مستوى المجموعة المتجانسة من المنتجات FP وذلك للمزايا التالية:

- المعاملات الفصلية تكون أكثر قوة: لأنها ستكون محسوبة على قيم مجمعة.
- التأثيرات فى تقليص المركبة الفصلية من جراء التداخل بين المنتجات منفردة ستكون معدومة.
- ظهور أى منتج جديد ببيانات زمنية قصيرة يمكن إلحاقه بالمركبة الفصلية المناسبة (مجموعة الانتماء)، ومن ثم يكون التنبؤ قد أخذ بعين الاعتبار التقلبات الفصلية.

### - تصفية (Filtrage) المسار الزمنى للسلسلة:

قبل حساب التنبؤ الإحصائى يجب تصحيح السلسلة الزمنية من الطلبيات الاستثنائية. وهذا التصحيح يمكن إجراؤه إما فى البداية عند أخذ الطلبية أو بعد الكشف عن القيم الشاذة أو غير الطبيعية.

الشكل البيانى رقم (١) المعاملات الفصلية لثلاث مجموعات من المنتجات



يمكننا انطلاقاً من سلسلة الاستهلاك FP المصححة من التقلبات الفصلية تحديد مجال للثقة محسوباً على المشاهدات الفصلية الأربع والعشرين الأخيرة:

$$IC = \bar{x} \pm t^a \times \sigma_x$$

حيث

$\bar{x}$  تمثل متوسط الاستهلاك المصحح فصلياً والمحسوب على المشاهدات الأربع والعشرين الأخيرة.

$\sigma_x$  الانحراف المعياري للاستهلاك المصحح فصلياً والمحسوب على المشاهدات الأربع والعشرين الأخيرة.

$t^a$  مؤشر قيمة التوزيع الطبيعي ضمن مستوى دلالة  $a = 1.96$  في حال أردنا فلترة (5%) من المشاهدات الأكثر ضعفاً أو الأكثر قوة)

كل المشاهدات الواقعة خارج هذا المجال تعتبر مشكوكاً فيها.

- تصحيح المسار الزمني للسلسلة:

الهدف هنا عزل المشاهدات غير الطبيعية أو الشاذة، وذلك باستبدالها بقيم أخرى، ويوحى نظام التنبؤ المستخدم بالكشف عن المشاهدات التي يمكن أن تكون شاذة ويقترح تلقائياً قيم أخرى لاستبدالها.

يوافق القائم على النظام على اقتراح التبدل أو يعدله، وهو الوحيد القادر من خلال معرفته بالسوق على تأكيد أو نفي أي جزء غير طبيعي في المعطيات.

- حساب التنبؤ:

يتم حساب التنبؤات على السلسلة الزمنية المصححة من التقلبات الموسمية والمصفاة من القيم غير الطبيعية بواسطة نموذج<sup>(1)</sup> Holt (صقل مركبة الاتجاه العام والمتوسط) مع إمكانية التحكم في المعاملات.

بعد إعادة المركبة الفصلية، يقوم النظام تلقائياً بتوليد التنبؤات بالمستوى FP لمجال زمني طوله (١٢) شهراً.

- التوافق بين التنبؤات لمجموعة المنتجات المتجانسة والتنبؤ للنشاط الإجمالي في فرنسا: أخيراً نجرى تجانساً بين التنبؤات على مستوى المجموعات المتجانسة من المنتجات مع التنبؤ للنشاط الاقتصادي (بواسطة نموذج الاقتصاد القياسي) الذي يأخذ بعين الاعتبار الحالة الاقتصادية. هذا التجانس يتم تبعاً للأوزان النسبية لكل تنبؤ (مجموعة × شهر).

(١) الفصل الثالث.

فإذا كان لدينا من أجل التوضيح البسيط فقط القيمة السنوية (٥٥٠٠٠٠) الناتجة من التنبؤ الاقتصادي القياسي للنشاط الإجمالي، فإن هذا التنبؤ يتم توزيعه أولاً على الأشهر الإجمالية بدلالة الوزن النسبي لكل شهر في السنة (الجدول ٤).

الجدول رقم (٤) التنبؤ قبل إدخال النموذج الاقتصادي القياسي

الشهر	FP1	FP2	FP3	FP4	الإجمالي غير المقيد	الإجمالي المقيد
J	٨٥١٦	١٢٩٢٤	٢١٥٨٧	٢٧٥٣	٤٥٧٧٩	٥٥٥٦١
F	٨٠٢٠	١٢٧١٩	١٠٣٠٢	٢٣٢١	٣٣٢٦٢	٤٠٣٦٩
M	٩٧٩٠	١٤٣٢١	١٢٦١٠	٢٤٩٤	٣٩٢١٥	٤٧٥٩٤
A	٤٧٦٣	١٩٩٦٢	٢٠٥٧٠	٣٢٢٠	٤٨٥١٥	٥٨٨٨٢
M	٧٠٨٩	١٧١٦٧	١٠٨٧٥	٢٢٤٥	٣٧٣٧٧	٤٥٣٦٣
J	٦٠٦٥	١٧٩٥٧	١٤١٢٠	٢٨١٧	٤٠٩٥٩	٤٩٧١١
J	٨٠٠٧	١٧٤٥٤	١٧٦٩٧	٣٣٩٨	٤٦٥٥٧	٥٦٥٠٦
A	١٥٥٢	٥٢٦٧	٤٩٦٨	١٠٥٩	١٣٨٤٦	١٥٥٩١
S	٦٧٤٦	١١٥٢٢	١٣٨٧٩	٢٧٥٣	٣٤٩٠٠	٤٢٣٥٧
O	٥١٩٠	١٣٩٤٨	٢٨٢٥٢	٢٢٧٠	٤٩٦٦٠	٦٠٢٧١
N	٧١٨١	١١٧٦٥	١٦١٢١	٢٦٤٤	٣٨٢١٢	٤٦٣٧٧
D	٥٧٨٥	١٠٠٣١	٦٩٨٩	٣٠٨١	٢٥٨٨٦	٣١٤١٨
الإجمالي	٧٨٧٠٤	١٦٥٠٣٨	١٧٨٣٦٩	٣١٠٥٥	٤٥٣١٦٦	٥٥٠٠٠٠

ثم بعد ذلك يتم توزيع إجمالي الشهر الناتج في الجدول (٤) على كل مجموعة من مجموعات المنتجات المتجانسة تبعاً للأوزان النسبية لكل مجموعة في الشهر الجدول (٥).

في حال إعادة تحديث القيم خلال العام، نقتطع من الإجمالي المحدد (المراد) المقدار المحقق من العام الجاري ثم نوزع الفرق، وفقاً للطريقة السابقة نفسها، على أشهر السنة المتبقية للتنبؤ.

الجدول رقم (٥) التنبؤ بعد إدخال النموذج الاقتصادي القياسي

		FP4	FP3	FP2	FP1	الشهر
٥٥٥٦١		٢٢٤١	٢٦٢٠٠	١٥٦٨٥	١٠٢٣٥	J
٤٠٣٦٩		٢٨١٧	١٢٣٨٢	١٥٤٣٧	٩٧٣٣	F
٤٧٥٩٤		٣٠٢٧	١٥٣٠٤	١٧٣٨١	١١٨٨٢	M
٥٨٨٨٢		٣٩٠٨	٢٤٩٦٥	٢٤٢٢٨	٥٧٨١	A
٤٥٣٦٣		٢٧٢٥	١٣١٩٩	٢٠٨٣٦	٨٦٠٤	M
٤٩٧١١		٣٤١٨	١٧١٣٨	٢١٧٩٤	٧٣٦١	J
٥٦٥٠٦		٤١٢٤	٢١٤٧٩	٢١١٨٤	٩٧١٨	J
١٥٥٩١		١٢٨٥	٦٠٣٠	٦٣٩٣	١٨٨٤	A
٤٢٣٥٧		٢٣٤١	١٦٨٤٤	١٣٩٨٤	٨١٨٨	S
٦٠٢٧١		٢٧٥٥	٣٤٢٨٨	١٦٩٢٨	٦٢٩٩	O
٤٦٣٧٧		٣٢٠٩	٢٠١٧٣	١٤٢٧٩	٨٧١٥	N
٣١٤١٨		٣٧٤٠	٨٤٨٢	١٢١٧٥	٧٠٢١	D
٥٥٠٠٠٠		٢٧٦٩١	٢١٦٤٨٣	٢٠٠٣٠٤	٩٥٥٢٢	الإجمالي

وكون التنبؤات بالحالة الاقتصادية قد تم حسابها بالقيمة فيمكننا تحويلها إلى كميات تقريبية من خلال تطبيق معامل  $déflatage$ .

#### ٥-٢-٢- التنبؤ على مستوى رقم المنتج Référéncé:

التنبؤات المتوافرة لدينا الآن هي على مستوى FP ولكن الغاية النهائية هي الحصول على التنبؤات على مستوى المنتج الواحد المخزن. وفقاً لمبدأ تجانس التنبؤات (مجموع التنبؤات لمستوى أدنى يجب أن يساوي التنبؤ للمستوى الأعلى)، من المناسب تحديد قاعدة لتفتيت التنبؤ إلى المستوى الأدنى.

القاعدة المختارة بسيطة فالتفتيت يتم وفقاً للوزن النسبي للمنتج في مجموعته (أي في الـ FP الخاص به) ومحسوباً بواسطة الصقل الآسي البسيط ( $a = 0.3$ ) على الأشهر الاثني عشر الأخيرة (الوزن يبقى ثابتاً على مجال التنبؤ).

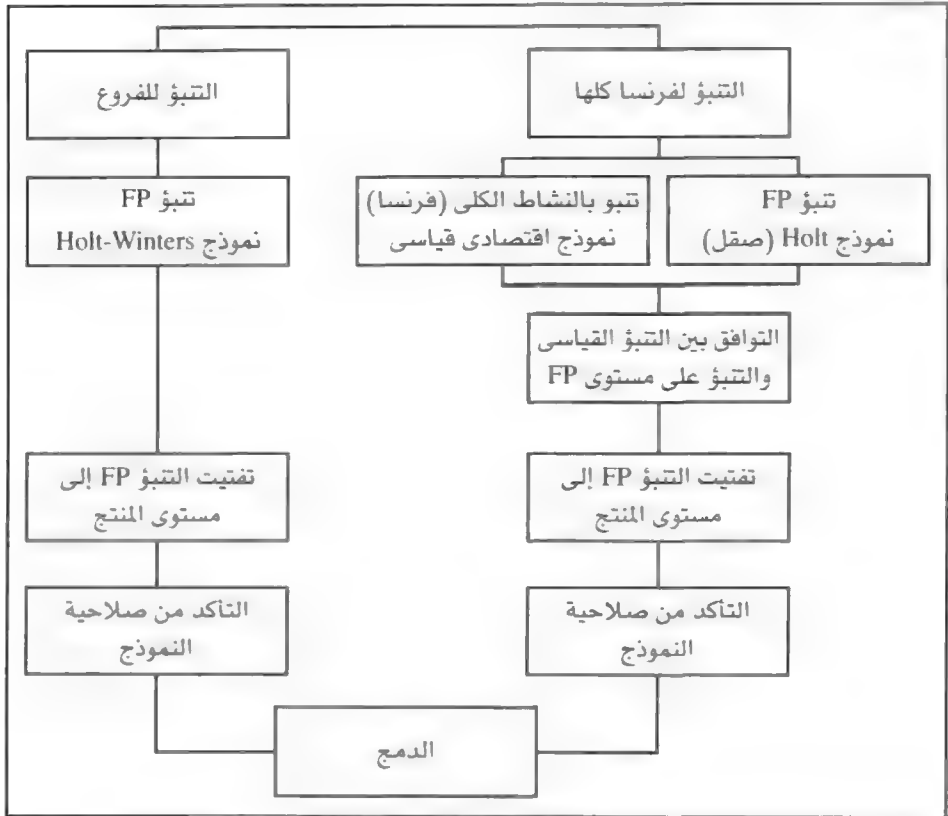
مجال التنبؤ يساوي ثلاثة أشهر بالنسبة لكل منتج مخزن.

### ٥-٣- التنبؤ بواسطة الفروع ودمجها:

كل فرع من الفروع المستقلة للشركة الأم يتحمل إجراء التنبؤات الخاصة به بمساعدة آلية معينة وضعت تحت تصرفه. النماذج المستخدمة هي من نوع الصقل الآسي. وبعد التحقق من صلاحية التنبؤات من قبل المسؤول عن الفرع يتم دمج التنبؤات للعودة إلى المستوى الكلي (المستوى ١).

يبين الرسم التوضيحي رقم (٥) آلية معالجة التنبؤ.

الرسم التوضيحي رقم (٥) مثال لنظام التنبؤ في المجال الصناعي



الغاية من المثال السابق إظهار كيفية استخدام طرائق التنبؤ التفسيرية. وكذلك الصقل الآسي في الطريقة التنبؤية الواحدة نفسها وإجراء التجانس فيما بينهما من أجل إدخال العناصر المتعلقة بالحالة الاقتصادية.



## الفصل السادس

### قطاع السلع الاستهلاكية المعمرة

بعد عرض خصائص قطاع السلع الاستهلاكية المعمرة نعرض أربعة أمثلة توضح آلية إجراء التنبؤ. المثال الأول مأخوذ من قطاع السيارات ويعالج سلعة ذات استثمار مهم للأسرة، في حين أن المثال الثاني يتعلق بسوق أجهزة تسجيل الفيديو ومن خلاله نتعرف على تقنية خاصة تتمثل في إدخال المتغير الصامت مما يمكننا من عزل حدث ما استثنائي يؤدي إلى زيادة في المشتريات. المثال الثالث يخص قطاع الهاتف الجوال الذي يُبرز أهمية السياسة الإرادية للمنشأة. المثال الأخير يستعرض نظاماً متكاملاً للتنبؤ متوسط الأجل (بواسطة متغيرات اقتصادية كلية) وللتنبؤ قصير الأجل.

#### ١- خصائص قطاع السلع الاستهلاكية المعمرة:

تمثل السلع الاستهلاكية المعمرة قطاعاً شديداً التنوع يشمل سلعاً كثيرة بدءاً بالسيارات ومروراً بالأجهزة الكهربائية المنزلية ووصولاً إلى أصغر جهاز كهربائي. ورغم هذه التنوع، فإن هناك بعض الخصائص العامة المميزة لهذه المنتجات تتعلق بها طريقة التنبؤ المختارة.

##### ١-١- البيع يتم للأسرة:

بعكس السلع الصناعية حيث يوجد عدد محدود من المشتريين، هناك عدد كبير من المشتريين بالنسبة للسلع الاستهلاكية المعمرة. كما أن الطلب على هذه السلع نادراً ما يواجه انخفاضات شديدة مفاجئة من عام إلى آخر. ففي فرنسا على سبيل المثال (٦٠) مليوناً من المستهلكين لا يتبنون عادة واحدة متجانسة في الشراء وإنما لديهم تنوع كبير ومهم في سلوكيات الشراء بعكس السلع الصناعية، فغالباً ما يكون هناك ثلاثة أو أربعة مشترين يشكلون الطلب الإجمالي. من هنا فإن الطرائق الداخلية للتمديد الخارجي للسلاسل الزمنية يمكن أن تكون مطبقة وإن كانت بشكل جزئي.

##### ١-٢- للسلع سوق مضاعف:

عندما تدخل سلعة جديدة إلى السوق كالهاتف المحمول على سبيل المثال تكون المبيعات للسنة الأولى محدودة جداً، ثم تبدأ بالزيادة السريعة المترافقة مع نمو في



معدل تجهيزات الأسر. وعندما يبدأ هذا المعدل بالارتفاع، (٢٠) إلى (٢٠٪) على سبيل المثال، ينمو طلب آخر هو الطلب على تجديد السلعة، أى إن السلع الأولى قد أصبحت مستعملة ويرغب المستهلكون فى استبدالها بتجهيزات جديدة أخرى. يوجد إذن سوق مضاعف:

- سوق التجهيز الأولي: ويعتبر مهماً فى مرحلة طرح المنتج فى السوق.
  - سوق الاستبدال: ويكون مهماً فى مراحل النضوج وبدء الانخفاض للمنتج.
- يتم إيجاد النموذج المناسب للتنبؤ، عند توافر المعطيات، لكل من هذين السوقين وهذا يحسن من جودة التنبؤ الحاصل.

### ١-٣- للمنشآت إمكانية التأثير فى السوق:

تلعب السياسة التسويقية للمنشأة، فى حالة هذا النوع من السلع، دوراً مهماً فى التأثير فى السوق. وهناك العديد من التأثيرات التى لا يستطيع القائم على التنبؤ أخذها بعين الاعتبار:

- «تأثير مواصفات المنتج»: مما لا شك فيه أن لنوع جيد من السيارات أو لنوعية سيئة لمكنسة كهربائية دوراً مهماً فى تحديد حجم المبيعات لتلك المنتجات، وفى حال إجراء تعديلات على مواصفات الجودة لتلك المنتجات فإن ذلك سينعكس على حالة السوق بتأثير ما لا يستطيع المتنبئ إدخاله فى معلومات التنبؤ المستخدمة.

كما يمكن الإشارة أيضاً إلى تأثير المنتج نفسه *effet de ligne* أو تشكيلة المنتجات *effet de gamme* التى لا يمكن أخذها أيضاً بعين الاعتبار لدى القائم على التنبؤ. فتأثير طرح نوع جديد من السيارات، وليكن MEGANE على مبيعات CLIO (تأثير تشكيلة المنتجات)، يمكن دراسته لاحقاً، ولكن من المستحيل إجراء مثل هذه الدراسة على مستوى التنبؤات الكمية.

كما يمكن أن يكون لمواصفات الموديل نفسه تأثير فى المبيعات (تأثير المنتج نفسه): سيارة ببابين، أربعة أبواب، مواصفات جديدة للمحرك أو للشكل ... إلخ.

المبيعات ستتأثر إيجاباً أو سلباً فى حالة تعديل مواصفات المنتج، وسيكون من الصعب إعطاء تقديرات تنبؤية كمية لتطور هذه السياسة.

بالمقابل هناك عناصر أخرى للسياسة التسويقية المختلطة Marketing-mix التى يمكن للقائم على التنبؤ أخذها بعين الاعتبار. نذكر منها:

- تأثير الارتفاع فى الأسعار.
- تأثير الاستثمار فى مجال الدعاية والإعلان فى الوسائل الأساسية كالصحف والراديو والتلفزيون.
- تأثير عمليات الترويج للمبيعات. رغم أن هذا التأثير لا يمكن بسهولة تلخيصه فى سلسلة زمنية واحدة كونه يشتمل على وسائل مختلفة (كوبونات، مسابقات، منشورات بريدية، ... إلخ).
- تدخل كل هذه المتغيرات الداخلية المتعلقة بالمنشأة فى بعض السلع الاستهلاكية المعمرة. ودراسة تأثيرها سيكون معالجا فى الفصل القادم (السلع ذات الاستهلاك الكبير) حيث يكون التدخل الإدارى للمنشأة أكثر أهمية ووضوحاً فى التأثير فى السوق.

#### ١-٤- فلتر مراقبة التوزيع:

- كلما اتجهنا نحو السلع الاستهلاكية ذات القيمة الفردية الصغيرة ، وجدنا أن المنافسة تتم من قبل الموزعين كما تتم من قبل المستهلكين النهائيين الذين لا يشترون إلا المنتجات التى تعرض عليهم بوسائل تشجيعية. فإذا كانت المراقبة قوية على شبكات التوزيع بالنسبة لمصنعي السيارات، فإنها أقل كثيراً بالنسبة لمصنعي الأدوات الكهربائية المنزلية الصغيرة. على سبيل المثال:
- يستطيع مسؤولو الرفوف وضع بعض السلع ظاهرة فى الأمام وبشكل خاص بعض الماركات دون غيرها.
- يمكن لبعض الموزعين استخدام المنتجات سلع جذب بأسعار مساوية أو أقل من سعر التكلفة، وذلك ضمن إطار سياستهم التسويقية دون أن يكتثروا بإستراتيجية المنتج بخصوص السعر أو مكان العرض.

#### ١-٥- تأثر المبيعات من السلع المعمرة ببعض الأحداث:

- يمكن أن نذكر هنا على سبيل المثال معارض السيارات التى تشكل مناسبة لمبيعات كبيرة من السيارات بشكل مباشر أو غير مباشر، وكذلك إن حوادث أخرى مثل الألعاب الأولمبية وكأس العالم لكرة القدم تقود إلى زيادة ملحوظة فى مبيعات أجهزة تسجيل الفيديو.

سنختبر الآن أربعة أمثلة تتعلق بنماذج التنبؤ للسلع الاستهلاكية المعمرة.

إن تحديد الطريقة الأمثل للتنبؤ يرتبط بالسعر الإفرادى للمنتج المراد التنبؤ به، على سبيل المثال:

- بالنسبة للسيارات (عشرات الآلاف من الفرنكات) نستخدم طرائق داخلية تعتمد على التنبؤ بمعدل اقتناء السيارة وبمعدل السيارات المحطمة، وكذلك نستخدم طرائق خارجية تأخذ بعين الاعتبار بعض العناصر المتعلقة بالوضع الاقتصادي العام كالدخل وشروط الاقتراض للشراء وغيرها.

- بالنسبة لأجهزة الفيديو (بضعة آلاف من الفرنكات)، نستخدم من أجل التنبؤ بها توفيقاً من الطرائق الداخلية (مركبة الاتجاه العام)، والخارجية (العناصر المرتبطة بالدخل وبحوادث استثنائية أخرى).

- أما بالنسبة للهاتف المحمول (بضع مئات من الفرنكات) فإننا نستخدم توفيقاً من العناصر الداخلية والخارجية المتعلقة بالمنشأة، وبذلك نكون أخذنا بعين الاعتبار كلا من تطور الطلب على هذه السلعة، والتأثير الإدارى للمنشأة فيها.

## ٢- معدل التجهيز وطلب الاستبدال: مثال السيارات:

### ٢-١- المبدأ الأساسى:

يتم التنبؤ بمرحلتين:

- إعداد نموذج للتنبؤ متوسط الأجل، ويمثل هذا النموذج النمو فى معدل التجهيز الأولى (أى معدل اقتناء السيارة فى حالة الطلب على السيارات) الذى يسمح بالحصول على النمو للأسطول البرى من خلال التنبؤات السكانية. من جهة أخرى، يتم الأخذ بعين الاعتبار لتطور سوق السيارات المحطمة فى دراسة التشوه الحاصل فى فترة حياة الأسطول البرى. ومن خلال هاتين المركبتين نحصل على تقدير للطلب متوسط الأجل.

- الحساب التراجعى: يستخدم هذا الإجراء بهدف فصل الانحرافات ما بين الطلب الملاحظ وبين الطلب المتوقع (الناتج من النموذج المختار). وتتم الاستفادة من هذه الانحرافات فى إنشاء نموذج تفسيرى يضم متغيرات اقتصادية كلية.

من هنا نلاحظ أن جودة التنبؤ فى الطلب على السيارات ترتبط بجودة التنبؤ للمتغيرات التفسيرية للنموذج.

## ٢-٢- نموذج التنبؤ متوسط الأجل:

الغاية من هذا النموذج هي التنبؤ السنوى بالطلب الإجمالى من السيارات أو بمعنى آخر التنبؤ بعدد القيود الجديدة المسجلة للسيارات. ليكن لدينا:

$I_t$ : القيود المسجلة للعام  $t$  (Immatriculations).

$P_t$ : الأسطول البرى من السيارات فى نهاية العام  $t$  (Parc automobile).

$C_t$ : السيارات المحطمة للعام  $t$  (Casse automobile).

يمكن التعبير عن العلاقة بين المتغيرات السابقة على النحو التالى:

$$I_t = P_t - P_{t-1} + C_t$$

وبكتابة  $\delta P_t = P_t - P_{t-1}$  التى تمثل الزيادة فى إجمالى أعداد السيارات خلال العام  $t$ ، تصبح العلاقة السابقة كما يلى:

$$I_t = \delta P_t + C_t$$

يجب التنبؤ بشكل منفصل بالعناصر الظاهرة فى العلاقة السابقة أى  $P_t$  و  $C_t$  للحصول على تنبؤ إجمالى للسيارات المسجلة.

- التنبؤ بزيادة الأسطول البرى من السيارات:

ليكن لدينا:

$P_t$ : الأسطول البرى من السيارات فى نهاية العام  $t$ .

$PO_t$ : عدد السكان فى نهاية العام  $t$ .

$TM_t$ : معدل امتلاك السيارة أى عدد السيارات لكل (١٠٠٠) ساكن فى نهاية العام  $t$ .

يكون لدينا:

$$TM_t = \frac{P_t \times 1000}{PO_t}$$

الفرضية الأولى بخصوص هذا النموذج هي أن تطور معدل اقتناء السيارة لا يرتبط بالحالة الاقتصادية العامة للبلد ولا بالهيكلية العمرية للأسطول البرى، ولكنه يتبع قانوناً للتطور الداخلى مرتبطاً بالزمن فقط. والقول بأن تطور حاجات بلد ما من الآليات يمكن تمثيله بواسطة نموذج داخلى أو ذى اتجاه عام يعنى تأكيد أن

تأثيرات الحالة الاقتصادية الجيدة أو السيئة في قيود تسجيل السيارات ينعكس على وضع المحطم من تلك السيارات، فعندما تكون الحالة العامة الاقتصادية جيدة فإننا نهمل السيارات القديمة ونشتري الجديد منها، وعندما تكون الحالة الاقتصادية غير مشجعة، فإننا نخفض من نسبة المحطم ونقلل من نسبة شراء الجديد.

تشرح بعض النماذج الرياضية<sup>(١)</sup> تطور مثل هذا النوع من الظواهر التي تتميز بانطلاقة بطيئة ثم تسارع ومرور بنقطة انعطاف، وأخيراً تباطؤ بالنمو واتجاه نحو معدل الإشباع.

يعتبر النموذج المنطقي *Modèle logistique* ممثلاً جيداً لهذه الظواهر (الشكل البياني رقم ١)، ويعبر عنه رياضياً بالعلاقة التالية:

$$TM_t = \frac{\overline{TM}}{1 + br^t}$$

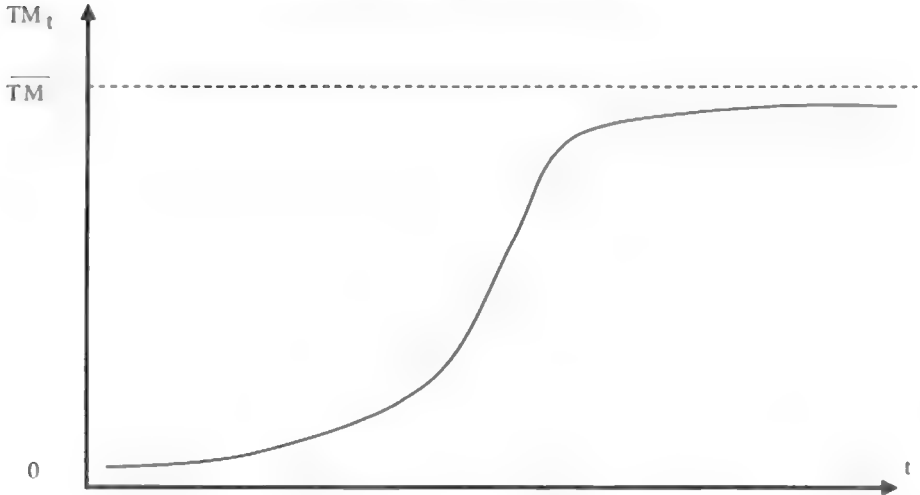
حيث:

$\overline{TM}$ : تمثل درجة الإشباع لمعدل امتلاك السيارة.

$r$ : معامل مرتبط بسرعة تطور الظاهرة.

$b$ : معامل مرتبط بنقطة البداية الزمنية.

الشكل البياني رقم (١) المنحنى المنطقي



(١) نماذج دورة حياة المنتج معروضة في الفصل السابع.

يتميز هذا النموذج بسهولة تقديره بواسطة الأداة "SOLVEUR" من البرنامج إكسل (الفصل السابع الجزء الأول).

- التنبؤ بعدد السيارات المحطمة (منتهية العمر):

يرتبط عدد المحطم من السيارات في العام  $t$  الذي نرسم له بالرمز  $C_t$  (المحطم يمثل «الموت» الطبيعي لانتهاؤ العمر أو بسبب الحوادث) بالحالة الاقتصادية (حيث لن نأخذ ذلك بعين الاعتبار في مرحلة أولى) وبحجم الأسطول البري من السيارات في نهاية العام  $t-1$  الذي نرسم له بالرمز  $P_{t-1}$  وبالهيكلة العمرية لهذا الأسطول. فعدد السيارات المحطمة يكون أكبر بالنسبة للأسطول البري القديم منه بالنسبة للأسطول البري الجديد. وعدم وجود سلاسل زمنية للمحطم من السيارات يقودنا إلى استخدام قانون احتمالي يمثل هذه السلسلة. نرسم بـ  $P_{t-1}^i$  عدد السيارات ذات العمر من  $i-1$  سنة إلى  $i$  سنة. في نهاية العام  $t-1$ :  $P_{t-1}^i = \sum P_{t-1}^i$  حيث يمثل  $i$  دليلاً يأخذ القيم من (0) إلى (20)، ونفترض أن عدد السيارات ذات العمر أكبر من (20) سنة يمكن إهمالها مقارنة مع الحجم الكبير للأسطول البري.

يمكن الوصول إلى السلسلة الزمنية الممثلة للمحطم من السيارات من خلال العلاقة التالية التي تربط بين عدد الأسطول البري وعدد قيود المسجل من السيارات:

$$C_t = I_t - (P_t - P_{t-1})$$

ولنرمز بـ  $S_t^i$  لاحتمال كون سيارة ذات العمر بين  $i-1$  و  $i$  سنة في نهاية العام  $t-1$  ما زالت «على قيد الحياة» ولم ترسل إلى مقبرة السيارات خلال العام  $t$ . يمثل الاحتمال المتمم  $1-S_t^i$  احتمال كون السيارة نفسها قد انتهى عمرها خلال العام  $t$ .

الأسطول الذي عمره ما بين  $i$  و  $i+1$  سنة في نهاية العام  $t$  سيكون مساوياً للباقي بعد سنة واحدة من الأسطول الذي عمره ما بين  $i-1$  و  $i$  سنة في نهاية العام  $t-1$ . يعبر عن هذه العلاقة الشكل التالي:

$$P_t^{i+1} = P_{t-1}^i$$

لتحديد حجم المحطم من السيارات يكفي معرفة البنية العمرية لأسطول السيارات للعام  $t-1$  أي  $P_{t-1}^i$  والتوزيع للقانون الاحتمالي للمتبقى على قيد الحياة من هذا الأسطول للعام  $t$ .

القانون الاحتمالى النظرى المناسب لهذه الظاهرة هو قانون توزيع بواسون وله الشكل التالى:

$$S_i^j = 1 - \sum_{k \leq i} \frac{e^{-\lambda_i} \times \lambda_i^k}{k!}$$

حيث تمثل  $\lambda$  معامل قانون بواسون ويجب تقديره.

- التنبؤ متوسط الأجل لعدد قيود المسجل من السيارات:

يمكننا الآن التنبؤ طويل الأجل بعدد قيود السيارات المسجلة للعام  $n + h$  الذى نرمز له بالرمز  $I_{n+h}$  من خلال الاستفادة من النمو فى عدد السيارات الإجمالية (الأسطول البرى) للعام  $n + h$  الذى يتم الحصول عليه بواسطة النموذج المنطقى ومن إجمالى السيارات منتهية العمر (المحطمة) للعام  $n + h$ .

نعبّر عن ذلك باستخدام تعبير «السوق الاحتمالى أو المتوقع» للعام  $n + h$ .

نشير أيضاً إلى أن هذه التنبؤات تأخذ بعين الاعتبار التشوه فى التوزيعات الاحتمالية للمتبقى «على قيد الحياة» من الأسطول البرى للسيارات حسب العمر ومع مرور الزمن وكذلك النمو فى معدل التجهيز.

## ٢-٣- إدخال المتغيرات التفسيرية فى النموذج:

الغاية من إدخال المتغيرات التفسيرية فى هذه الحالة هى التنبؤ بالطلب الإجمالى للظاهرة المدروسة لمدة سنتين، مع الأخذ بعين الاعتبار البيئة الاقتصادية الكلية.

يُعرف السوق فى السنة  $t$  أى  $I_t$  أنه المجموع للزيادة فى الأسطول البرى للعام  $t$  أى  $\delta p_t$  وللمحطم من السيارات فى العام نفسه  $C_t$ . ويتم تحديد هذا السوق بشكل كامل من خلال معرفة المؤشرات التالية:

-  $\overline{TM}$  التى تمثل قيمة الإشباع لمعدل امتلاك السيارة.

- المؤشر  $\lambda$  الممثل للتوزيع الاحتمالى للمحطم من الأسطول البرى للعام  $t$  حسب عمره.

يمكننا الربط بين هذا المؤشر  $\lambda$  والمؤشرات الأخرى الاقتصادية الكلية ذات العلاقة بالحالة الاقتصادية العامة. ومن ثم فإن معرفة القيم المأخوذة من قبل هذه المتغيرات الكلية على المجال الزمنى المطلوب تسمح لنا بتعريف احتمالية مختلفة لتحطيم السيارة (فى الحالة الاقتصادية السيئة يكون هناك ميل لدى الأسر لتصليح سياراتهم).

المتغيرات الاقتصادية الكلية التى تم اختبارها فى حالتنا هذه وعلى مستوى فرنسا هى التالية:

- مؤشر الأسعار العام.
  - الاستهلاك الخاص (حجم).
  - الاستهلاك الخاص (قيمة).
  - أسعار الكتالوج النسبية (سعر الكتالوج للعام الماضى بالفرنك الجارى / المؤشر العام للأسعار).
  - مؤشر شروط الاقتراض.
  - السيولة لدى الأسر (قيمة).
  - السيولة لدى الأسر (حجم).
  - معدل البطالة (الأشخاص دون عمل المسجلين لدى مكاتب التوظيف بمتوسط سنوى / عدد السكان النشيطين فى منتصف العام).
- باستخدام طرائق انتقاء المتغيرات التفسيرية المشروحة فى الفصل الرابع (الفقرة ٢-٥) نصل إلى نموذج انحدار <sup>(١)</sup> من النمط التالى:

$$\lambda_t = a_1 P_t + a_2 LMVO_t + a_3 CPVO_t + a_4 \lambda_{t-1} + a_0$$

حيث:

- $P_t$ : المؤشر العام للأسعار.
- $LMVO_t$ : حجم السيولة لدى الأسر.
- $CPVO_t$ : حجم الاستهلاك الخاص.

## ٢-٤- التنبؤ قصير الأجل:

بعد أن يتم حساب التنبؤ متوسط الأجل والتحقق منه بشكل سنوى يكون ضرورياً الحصول على التنبؤ قصير الأجل أى لفترات شهرية.

(١) يعتبر نموذج الانحدار الذاتى نموذجاً تفسيرياً يتم من خلاله اعتبار المتغير الواجب تفسيره باعتباره متغيراً تفسيرياً مؤخراً لفترة زمنية واحدة أو أكثر. أى إننا نشرح المتغير التابع من خلال قيمه السابقة.



يتم في المرحلة الأولى من حساب التنبؤات الشهرية تحديد المعاملات الفصلية الشهرية باستخدام الشكل التضاربي (انظر الفصل الثاني) ويُعبر عنها بشكل نسبي. بعد ذلك يتم حساب التنبؤ قصير الأجل بسهولة من خلال تقسيم التنبؤ السنوي إلى أشهر بدلالة التصحيح لأيام العمل وللمعاملات الفصلية. مع الأخذ بعين الاعتبار تأثير مركبة الاتجاه العام بين السنوات.

من مزايا هذه الطريقة أنها تسمح لنا بالبحث عن النماذج المناسبة المتعلقة بالزيادة في الأسطول البري والنماذج الخاصة بالمحطم من السيارات. كما تتميز بإدخال متغيرات تفسيرية تتعلق بالحالة الاقتصادية العامة المؤثرة في سلوكيات الأسر.

### ٣- التأثير للحوادث الاستثنائية: مثال أجهزة الفيديو:

#### ٣-١- وضع المسألة وطريقة المعالجة:

غالباً ما تواجه المؤسسات المنتجة أو المستوردة أو الموزعة لأجهزة الفيديو تقلبات فصلية مهمة عائدة بشكل خاص لتأثير بعض الحوادث المتلفزة التي تؤدي إلى زيادة في الطلب على هذه الأجهزة. ولأخذ بعين الاعتبار لهذه العناصر غير الثابتة فإننا نستخدم طريقة المتغيرات الصامتة *La méthode des variables muettes*.

#### ٣-٢- إدخال الحوادث الاستثنائية باستخدام متغير صامت:

يتم شراء أجهزة الفيديو لتسجيل بعض البرامج أو المسلسلات التي تهتم المشتري وخصوصاً بعض المجرىات الرياضية كالألعاب الأولمبية على سبيل المثال. لذلك من الضروري الأخذ بعين الاعتبار هذه الظواهر التي تشوش الحركة الاعتيادية لمسار السلسلة الزمنية الممثلة لمبيعات هذه الأجهزة، ومن أجل ذلك فإننا ننشئ متغيراً صامتاً أي سلسلة لا تأخذ إلا القيم (عندما لا تحدث الظاهرة) وعندما تتحقق تلك الظاهرة. في المثال الحالي. ليس لكل الحوادث الصدى نفسه بالنسبة للمشتري، ومن ثم لا بد من إحصاء الحوادث الممكن أن تدخل في إطار هذا التحليل لإنشاء تدرج فيما بينها، على سبيل المثال:

- حوادث من النوع الأول (كأس أوروبا لكرة القدم).
- حوادث من النوع الثاني (كأس العالم لكرة القدم).
- حوادث من النوع الثالث (الألعاب الأولمبية)، ... إلخ.

التثقييل لكل نمط من الحوادث السابقة يتم من خلال المختصين وتبعاً لشكل التأثير ويمكن إنشاء المتغير الصامت من خلال الإدراك المسبق الجدى حول التأثير النسبى لمختلف الظواهر ، مع الأخذ بعين الاعتبار شكل امتصاص أو تلاشى هذه الحوادث، فالطلب المتضخم بشكل اصطناعى يمكن أن ينخفض فيما بعد لتعويض الارتفاع السابق. تعتبر الحوادث من النوع الأول الأخفض من ناحية التثقيلات، وهى تعطى قيمتين يساوى كل منهما (٠.٢٥)، الأولى فى شهر الحدث نفسه والثانية فى الشهر السابق للحدث. ودون وجود امتصاص بعد ذلك. بالنسبة للنوع الثانى فإن التثقييل يساوى (٠.٢٥) للشهرين السابقين و(٠.٥) لشهر الحدث و(٠.٢٥-) للامتصاص فى الشهرين التاليين. فى النوع الثالث نعطى (٠.٢٥) للشهرين السابقين ولشهر الحدث، و(٠.٢٥) كامتصاص للشهر التالى للحدث. لا يمكن للمجموع على الشهر نفسه لعدة حوادث أن يتجاوز القيمة (٠.٥).

بمساعدة هذه الفرضيات، يمكننا إنشاء متغير تفسيرى خاص يأخذ بعين الاعتبار هذه الحوادث. ويظهر هذا المتغير بعد ذلك فى نموذج التنبؤ فى الوقت نفسه مع مركبة الاتجاه العام (التطور الطبيعى للمبيعات) ومتغير النفقات الدعائية ومتغير دخل الأسر والتخفيضات ... إلخ.

#### ٤- التنبؤ للأسواق الجديدة: سوق الهاتف المحمول:

##### ٤-١- عرض المشكلة:

يعتبر سوق الهاتف الجوال من الأسواق الحديثة المتميزة بنمو كبير وغير مشبع. ففى فرنسا هناك ثلاثة مزودين للخدمة: Itineris, SFR, Bouygues Telecom. وهذا الوضع من احتكار الأقلية يولد نشاطاً تسويقياً قوياً جداً وعروضاً كثيرة وجديدة. لا يمكننا هنا استخدام طرائق التنبؤ التقليدية للسلاسل الزمنية المستندة إلى تحليل مسار المبيعات لهذه السلاسل. فلا بد إذن من شرح التقلبات فى حصة السوق بواسطة العوامل الخارجية (الدعاية، ترويج المبيعات، معدل التغطية، ...).

نفترض فى حالتنا هذه وجودنا فى نهاية العام ١٩٩٨<sup>(١)</sup> ونرغب فى إجراء التنبؤ للعام ١٩٩٩. يجب على النموذج المستخدم إعطاء تنبؤ لعدد المشتركين (مشتري بطاقة SIM<sup>(٢)</sup>) لمدة (١٢) شهراً. التنبؤ هنا يتم على مستويين، التنبؤ بالسوق والتنبؤ بحصة السوق.

(١) طريقة التنبؤ المعتمدة هنا تتفق مع فترة البيانات المتوافرة وتتناسب مع مرحلة من مراحل حياة المنتج وهى غير صالحة للتطبيق فى مرحلة الإشباع حيث يكون السوق مستقراً.

(٢) تمثل هذه البطاقة الوسيلة المستخدمة لتفعيل الخط الهاتفى والتعريف بحامله.

## ٤-٢- التنبؤ بالسوق:

يمثل السوق المبيعات الإجمالية الشهرية (على ٢٦ شهراً) من البطاقات SIM. ولإجراء التنبؤ تم اعتماد طريقة من النوع الداخلى، وذلك لأنه لا يوجد أى متغير تفسيري سوى النمو الطبيعى للسوق، يسمح بنمذجة تطور هذا السوق بإحدى طرائق التحليل الخارجية. مراحل الحساب هى التالية:

## - تحليل الفصلية وحساب السلسلة المصححة من التقلبات الفصلية:

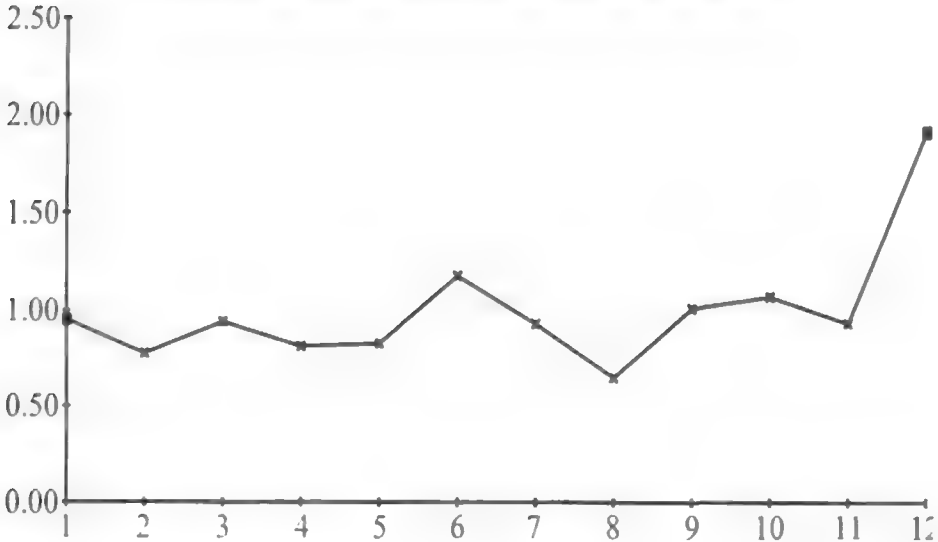
يشير الرسم الممثل لتحليل المركبة الفصلية (الرسم البيانى ٢) إلى وجود بروز مهم جداً فى شهر كانون أول (هدايا نهاية العام)، وذلك لأن المبيعات من البطاقات يبدو أكبر بمرتين من المتوسط العام للمبيعات فى السنة.

وبعد حساب المعاملات الفصلية يمكننا حساب قيم السلسلة الجديدة المصححة من التقلبات الفصلية CVS.

## - إيجاد النموذج بواسطة الصقل الأسى:

تم استخدام نموذج Holt (الصقل لمركبة الاتجاه العام وللمركبة الفصلية) على السلسلة منزوعة المركبة الفصلية. يبين الجدول (١) نتائج التقدير لنموذج Holt.

الشكل البيانى رقم (٢) المركبة الفصلية للهاتف الجوال (اشتراك)



الجدول رقم ١١: النموذج Holi المطبق على المبيعات CVS من البطاقات SIM بالآلاف (الملف C6EX1.XLS)  
ALPHA ٠.٢٠ BETA ٠.٣٠

التاريخ	المبيعات CVS	$a_{0h}$	$a_{1h}$	التنبؤ
٩٦-٢	٦٣.٦٧	٦٣.٦٧	٠.٠٠	-
٩٦-ش	٩٩.٩٩	٧٤.٥٧	٢.١٨	٦٣.٦٧
٩٦-١	٩٠.٩٦	٨١.٠١	٣.٠٣	٧٦.٧٥
٩٦-٢	١٠٦.٤١	٩٠.٧٥	٤.٣٧	٨٤.٠٤
...	...	...	...	...
٩٨-أب	٥٤٦.٤٨	٥٧٢.٩٣	١٥.٧٦	٥٨٤.٣٦
٩٨-١	٦١٦.٥٠	٥٩٧.٠٣	١٧.٤٣	٥٨٨.٦٩
٩٨-١	٦٦٤.٧٠	٦٢٩.٧٠	٢٠.٤٤	٦١٤.٤٦
٩٨-٢	٧٣٥.٣٢	٦٧٥.٥٨	٢٥.٢٦	٦٤٩.٩٧
٩٨-١	٥٦٩.٥٢	٦٦١.٦٥	١٧.٦٧	٧٠١.١٤

#### - التنبؤ والمعالجة الفصلية:

في شهر كانون أول من العام ١٩٩٨ ووفقاً لمعطيات الجدول السابق لدينا متوسط للمبيعات يساوي (٦٦١.٦٥). ونمو مقداره (١٧.٦٧) شهرياً، ومن أجل مجال زمني قدره (١٢) شهراً يكون لدينا. بتطبيق العلاقة الكلاسيكية على الفترة الأخيرة:  $(١٢ \times ١٧.٦٧) = ٢١٢.٠٠٤$  أي نحو (٢٠٠٠٠٠) مشترك إضافي كل شهر، ولكي نكون عقلانيين في حساباتنا فإننا نستخدم إجراء رياضياً  $(\sqrt{h})$  يخفف من حركة الاتجاه العام مع اعتبار  $h$  مجال التنبؤ حيث  $h = 1, 2, \dots, 12$ .

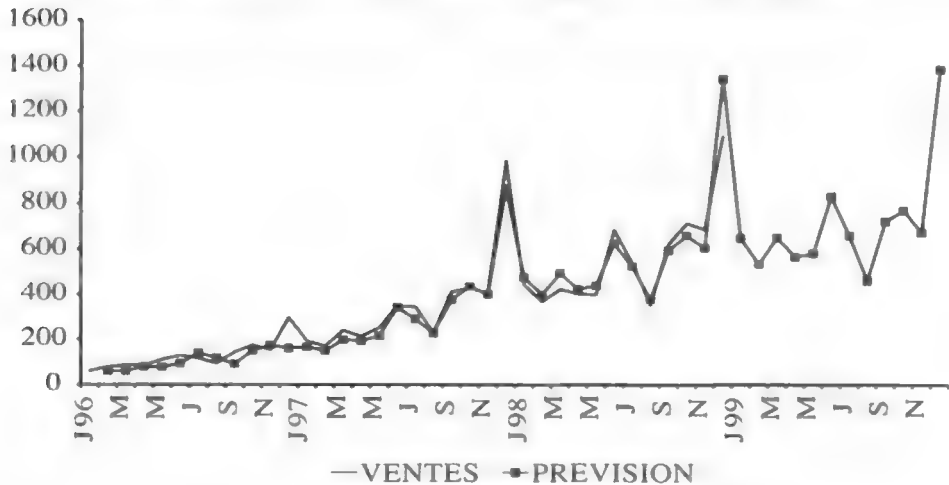
فمن أجل شهر نيسان لعام ١٩٩٩:  $661.65 + 17.67 \times \sqrt{4} = 696.98$ . يبين الجدول رقم (٣) هذه التنبؤات.

الجدول رقم (٢) التنبؤ والمعالجة الفصلية

التنبؤات الفصلية	المعاملات الفصلية	التنبؤ CVS	التاريخ
٦٤٧,٨٧	٠,٩٥	٦٧٩,٣٢	ك-٢-١٩٩٩
٥٣٣,٦٨	٠,٧٨	٦٨٦,٦٣	شباط
٦٥١,٢٨	٠,٩٤	٦٩٢,٢٥	آذار
٥٦٦,٧٥	٠,٨١	٦٩٦,٩٨	نيسان
٥٨١,٥٠	٠,٨٣	٧٠١,١٥	أيار
٨٣٠,١٤	١,١٨	٧٠٤,٩٢	حزيران
٦٦٠,٢٩	٠,٩٣	٧٠٨,٣٩	تموز
٤٦١,٣٣	٠,٦٥	٧١١,٦٢	أب
٧٢١,٦٧	١,٠١	٧١٤,٦٥	أيلول
٧٦٩,٥٩	١,٠٧	٧١٧,٥١	ت أول
٦٧٣,٠٢	٠,٩٣	٧٢٠,٢٤	ت ثان
١٣٨١,٢٩	١,٩١	٧٢٢,٨٥	ك

يبين الشكل البياني رقم (٢) القيم الحقيقية المحققة والقيم المتنبأ بها للمبيعات من البطاقة SIM بالآلاف.

الشكل البياني رقم (٣) المحقق والمتنبأ به من مبيعات البطاقة SIM (بالآلاف)



#### ٤-٣- التنبؤ بحصص السوق:

يرتبط التغير في حصة السوق لأحد مقدمى الخدمة بالنفقات الإعلامية وبعمليات الترويج للمبيعات التى يقدمها للمشاركين، وكذلك بمعدل التغطية (فى العام ١٩٩٨ وفى أثناء إجراء هذه الدراسة لم يكن لأى مقدم لهذه الخدمة تغطية فى حدودها العظمى).

النموذج التالى هو المستخدم للتنبؤ بحصة السوق لمقدم خدمة ما<sup>(١)</sup>:

$$PM_i = a_0 + 0.09 \times IP_i + 0.19 \times PP_i + 0.11 \times TC_i$$

حيث:

$PM_i$ : حصة السوق للشهر  $i$ .

$IP_i$ : مؤشر السعر المتوسط للدقيقة الواحدة فى الشهر  $i$ .

$PP_i$ : متغير ترويجى يتعلق بالعرض التشجيعى "Pack" للشهر  $i$ .

$TC_i$ : معدل التغطية للسكان الفرنسيين للشهر  $i$ .

نلاحظ من المعادلة المقدرة أن المتغير المتعلق بالعرض التشجيعى يلعب الدور الأهم فى زيادة حصة السوق، ويأتى بعد ذلك متغير معدل التغطية ومن ثم متغير سعر الدقيقة.

يأخذ هذا النموذج بعين الاعتبار السياسة الإرادية لمقدم الخدمة المتعلقة بحصته فى السوق، وإذا تم التأكد من صلاحية هذا النموذج فإنه يسمح بإجراء التنبؤ لحصة السوق مع بعض الافتراضات المتعلقة بالقيم المستقبلية للمتغيرات التفسيرية، وهذه الافتراضات ممكنة التحقق لأن العوامل التفسيرية مدارة من قبل مقدم الخدمة.

#### ٤-٤- التنبؤ بعدد المشتركين:

يتم الحصول على التنبؤ النهائى بعدد المشتركين من خلال المقابلة بين التنبؤ بالسوق والتنبؤ بحصة السوق. مجال التنبؤ المستخدم هو (١٢) شهراً.

يناسب نموذج التنبؤ المستخدم هنا مرحلة حياة محدّدة لنشاط الهاتف المحمول (العام ١٩٩٩) إذ لم يكن هذا السوق فى ذلك الوقت مشبعاً وكان هناك نشاط تسويقى كبير ومعدلات تغطية غير تامة، وعندما تتغير هذه الشروط يصبح ضرورياً إجراء تعديل على تقنية التنبؤ بحيث تتلاءم مع المواصفات الجديدة لهذا النشاط.

(١) القيمة المقدرة للحد الثابت  $a_0$  ليست معروضة.

## ٥- مثال للتنبؤ ببيع قطع غيار السيارات: إنشاء شبكة إمداد متكاملة :chaîne logistique intégrée

### ٥-١- عرض المسألة:

المنشأة هنا تقوم بتوزيع الإكسسوارات وقطع الغيار للسيارات (مساحات الزجاج، الأصبغة، لمبات كهربائية، بطاريات... إلخ) بإجمالي قدره (١٥٠٠٠) مادة بأرقام تعريفية لكل منتج، وهذه المواد تم تجميعها ضمن مجموعات تجارية متجانسة عددها (١٥٠). تلعب التأثيرات الدعائية للموزعين (وكلاء السيارات) دوراً مهماً جداً في المبيعات، وعادة ما تقوم شركات الإعلان بهذا الدور ويكون العنصر الأساس هو تخفيض السعر عند الشراء بكميات.

الهدف من وضع نظام للتنبؤ والتخطيط هو تحسين أداء إدارة المخزون أى تخفيض مستوى المخزون مع زيادة جودة معدل الخدمة. إن التوافق بين هذين الهدفين المتعارضين مبدئياً يمكن الوصول إليه من خلال وجود نظام يعمل على جعل التدفقات الفيزيائية من البضائع فى الشكل الأمثل، وهذه التدفقات تشمل محفظة الطلبات (المشتريات والزبائن)، مستوى المخزون الموجود، جودة الخدمات المرغوب فيها، التنبؤات قصيرة الأجل وطويلة الأجل. ولكى تكون هذه الشبكة اللوجستية على النحو الأمثل، نستخدم النظام المسمى (Distribution Requirement Planning) DRP. ويعتبر وجود نظام آلى للتنبؤ وللتخطيط أداة مساعدة لدى الإداريين فى اتخاذ القرار.

يوجد عدة غايات لإجراء التنبؤ فى قطاع سلع قطع الغيار:

- فالتنبؤ على المدى الطويل يفيد بتعريف إستراتيجية المنشأة.

- والتنبؤ على المدى المتوسط يساعد فى تجهيز الميزانيات.

- والتنبؤ على المدى القصير جداً يسهم فى جعل الإمدادات فى حدودها المثلى.

يتم إجراء التنبؤ على المدى الطويل (٢ سنوات) بشكل تجميعى (على مستوى المجموعات المتجانسة من المنتجات) والميزانية المحضرة فى شهر حزيران من العام A للعام التالى A-1 تدخل ضمن التقسيم نفسه. أما التنبؤات للاستهلاك القصير الأجل فيتم تحضيرها على مستوى المنتجات الفردية.

## ٥-٢- الخطة التسويقية للمبيعات:

تهدف الخطة التسويقية إلى حساب تنبؤات سنوية للمبيعات لكل مجموعة من المجموعات المتجانسة من المنتجات حسب البلد. ويعبر عن هذه التنبؤات بالحجم ولكن يمكن التعبير أيضاً عنها بأرقام الأعمال.

يتم الحصول على الخطة التسويقية الثلاثية كل عام في شهر آذار وتغطي فترة السنوات الثلاث القادمة.

ولكون قطاع قطع الغيار مرتبط بشدة بالبيئة الاقتصادية العامة وبشكل خاص ببيئة قطاع السيارات، فإنه يتم الحصول على التنبؤ انطلاقاً من نموذج تفسيري، حيث يتم حساب التنبؤات بالحجم من خلال تقنية الانحدار المتعدد وتبعاً لمؤشرات تطور السوق التي يمكن أن تشمل:

- مؤشرات اقتصادية كلية (معدل الفائدة، استهلاك الأسر، الادخار، ... إلخ).
- مؤشرات قطاعية (عدد قيود التسجيل للسيارات، الأسطول البري، ... إلخ).
- مؤشرات تتعلق بالسياسة التسويقية للمنشأة (ميزانية ترويج المبيعات، عدد الزيارات التي يجريها البائعون، ... إلخ)

اعتماداً على الفرضيات الخاصة بتطور هذه المؤشرات المختلفة، يمكن حساب التنبؤ للأعوام  $A+1$ ،  $A+2$  و  $A+3$ .

يمكن تحويل التنبؤات حسب الحجم إلى تنبؤات حسب رقم الأعمال من خلال السعر المتوسط للوحدة الواحدة.

يقوم مدير النظام (رئيس تسويق المنتج) باقتراح المؤشرات الممكن إدخالها في النموذج، ومن خلال النظام المزود بآلية انتقاء أوتوماتيكية لهذه المتغيرات يتم تحديد نموذج التنبؤ الأمثل الذي سيكون خليطاً من المؤشرات التفسيرية.

على سبيل المثال، من أجل مجموعة المنتجات المتعلقة بلمبات الإنارة للسيارات، يكون النموذج المقدّر على (١٠) سنوات ( $t = 1.10$ ) هو التالي:

$$V_t = 3.4 R_{ro_t} + 10.8 R_{arc_t} - 1.8 T_{ir_t} + 320.1$$

(0.9)                      (3.2)                      (0.5)

$$R^2 = 0.89$$

$$n = 10$$



حيث:

 $V_i$ : المبيعات من مجموعة لمبات الإنارة للعام  $i$ . $Pro_i$ : التخفيضات المعبر عنها بالفرنك للعام  $i$ . $Parc_i$ : أسطول السيارات المعبر عنه بـ (١٠٣) (لجزء من السوق). $Tir_i$ : معدل الفائدة الحقيقي. $R^2$ : معامل التحديد. $n$ : عدد المشاهدات.

الأرقام الموجودة بين أقواس وتحت قيم المعاملات المقدرة تمثل الانحرافات المعيارية للمعالم المقدرة.

- التفسير:

يتم الحكم بشكل أساسى على الجودة الإحصائية لنموذج الانحدار المتعدد من خلال تفسير الانحرافات المعيارية للمعالم المقدرة.

يكفى من أجل ذلك إجراء مقارنة بالقيمة المطلقة للنسبة ما بين قيمة كل معامل من المعاملات المقدرة إلى انحرافه المعيارى مع القيمة الجدولية لتوزيع ستيودنت ذى  $n - k - 1$  درجة حرية (تمثل  $k$  عدد المتغيرات التفسيرية وهنا تساوى ٣) وضمن مستوى دلالة  $\alpha$  مختار ( $t_6^{0.05} = 2.36$ ). فى مثالنا الحالى، النسب الثلاثة ( $3.6 = 1.8/0.5$ ,  $3.4 = 10.8/3.2$ ,  $3.7 = 3.4/0.9$ ) أعلى من القيمة (٢.٣٦)، ومن ثم فإن المؤشرات المنتقاة تشرح التقلبات فى المبيعات من المادة المذكورة.

يمكن بعد ذلك الحصول على التنبؤات من خلال وضع قيم المؤشرات التفسيرية للسنوات المختارة فى النموذج المقدر.

على سبيل المثال، بالنسبة للعام ١١:

$$V_{11} = 3.4 Rro_{11} + 10.8 Rarc_{11} - 1.8 Tir_{11} + 320.1$$

$$V_{11} = 3.4 \times 5500 + 10.8 \times 126 - 1.8 \times 6.2 + 320.1 = 20369$$

### ٣-٥- تحضير الميزانية المتحركة للمبيعات:

يتم تحضير ميزانية المبيعات من واقع الخطة التسويقية للعام  $A$  ويتضمن ذلك حساب الميزانيات الشهرية للمبيعات باستخدام المعاملات الفصلية المحسوبة على

السلسلة الزمنية المكونة من أربع سنوات، وذلك كما هو موضح فى الجدول رقم (٢) بالنسبة لمجموعة سلع لمبات الإنارة الخاصة بالسيارات.

الجدول رقم (٣) حساب الميزانيات الشهرية لخطة التسويق

الميزانية الشهرية	المعاملات الفصلية	الشهر
١٥٢٢	٠.٩٠	ك
١٥٥٧	٠.٩٢	شباط
١٩٥٧	١.١٥	آذار
١٩١٧	١.١٣	نيسان
١٥٨٣	٠.٩٣	أيار
١٣٩١	٠.٨٢	حزيران
٢٢٠٧	١.٣٠	تموز
١٤٧٢	٠.٨٧	آب
١٣١١	٠.٧٧	أيلول
١٨٣٨	١.٠٨	ت أول
١٨١٦	١.٠٧	ت ثان
١٧٩٧	١.٠٦	ك
٢٠٣٦٩	الإجمالى	

#### ٥-٤- التنبؤ بالمبيعات حسب رقم المنتج (Référence):

يتم حساب التنبؤات للمواد المصنفة حسب مرجعيتها، فى مرحلة أولى، بواسطة نموذج Holt-Winters. وهذه التنبؤات لا (١٥٠٠٠) مادة تتم بشكل منفصل كلياً عن التنبؤات السابقة المحسوبة حسب المجموعات.

ولكن وفقاً لمبدأ التجانس فى التنبؤات فإن مجموع التنبؤات لمستوى أدنى يجب أن يساوى التنبؤ فى المستوى الأعلى، ومن ثم فإنه من المناسب إجراء عملية «ضبط» normaliser للتنبؤات حسب رقم المنتج.

نجرى إذن فرضية أن التنبؤ فى المستوى الأعلى هو دائماً أفضل من مجموع التنبؤات فى المستويات الأدنى. فكلما تعاملنا مع مستوى تجميعى أو على مستوى عدة مواد أو

لفتحات أكثر طولاً أو كليهما، أصبح خطأ التنبؤ المتوقع أقل. فتجميع التنبؤات المحسوبة على مستوى دقيق جداً يقود إلى خطر الوقوع فى أخطاء كبيرة، وذلك لأن تباينات الأخطاء تتراكم بالقيمة المطلقة. الجدول رقم (٤) يبين حساب الضبط للتنبؤات.

الجدول رقم (٤) ضبط التنبؤات المحسوبة على مستوى المنتج لشهر ما

بعد الضبط	قبل الضبط	
٤٠٠	٤٠٠	التنبؤ حسب المجموعة
٤٠٠	٣٥٦	إجمالى المواد
٢٥٨	٢٣٠	التنبؤ للمادة ١
١٣٥	١٢٠	التنبؤ للمادة ٢
٧	٦	التنبؤ للمادة ٣

فى نهاية هذه المرحلة نحصل على التنبؤات للاستهلاكات الشهرية حسب كل منتج. وهذه التنبؤات تتوافق كلياً مع خطة التسويق للمبيعات ومع الميزانية.

#### ٥-٥- خطة التمويل<sup>(١)</sup> والإمداد:

يتعلق حساب "Distribution Requirement Planning" DRP بالتمويل المتبوءة المستندة إلى التنبؤات بالاستهلاك التى تأخذ بعين الاعتبار القيود، وكذلك السياسات الخاصة بإدارة المخزون للمنتجات حسب أهميتها من ناحية الجودة للخدمة، وتدوير المخزون، وعدد الممولين، ... إلخ.

تسمح هذه المرحلة الأخيرة من مراحل الشبكة اللوجستية لـ DRP بإنشاء خطة للمخزون وخطة للتمويل الأسبوعى وذلك تبعاً لتنبؤات الاستهلاك وللمخزون الموجود ولحركة الطلبات.

تمثل الكميات المحسوبة للتمويل من المواد المتوقع استهلاكها القيم المثلى للطلبية ولكن يمكن لهذه الكميات أن تكون معدلة تبعاً لبعض القيود مثل تلك الناجمة عن عملية تجميع الطلبات لغايات اقتصادية أو إدارية أو مالية (الحسميات تبعاً لأرقام المبيعات).

(١) حول العلاقة بين التنبؤ بالطلب والتمويل يمكن العودة إلى المقالة «كيف نجعل التمويل فى الشكل الأمثل» ١٩٩٥، Bourbonnais, Vallin.

عند وجود طلب للتموين من مادة ما، يتم تحديد الكمية المثلى المطلوب إعادة التموين بها بشكل أوتوماتيكي، وتمثل اقتراحاً يجب المصادقة عليه من قبل إدارة النظام.

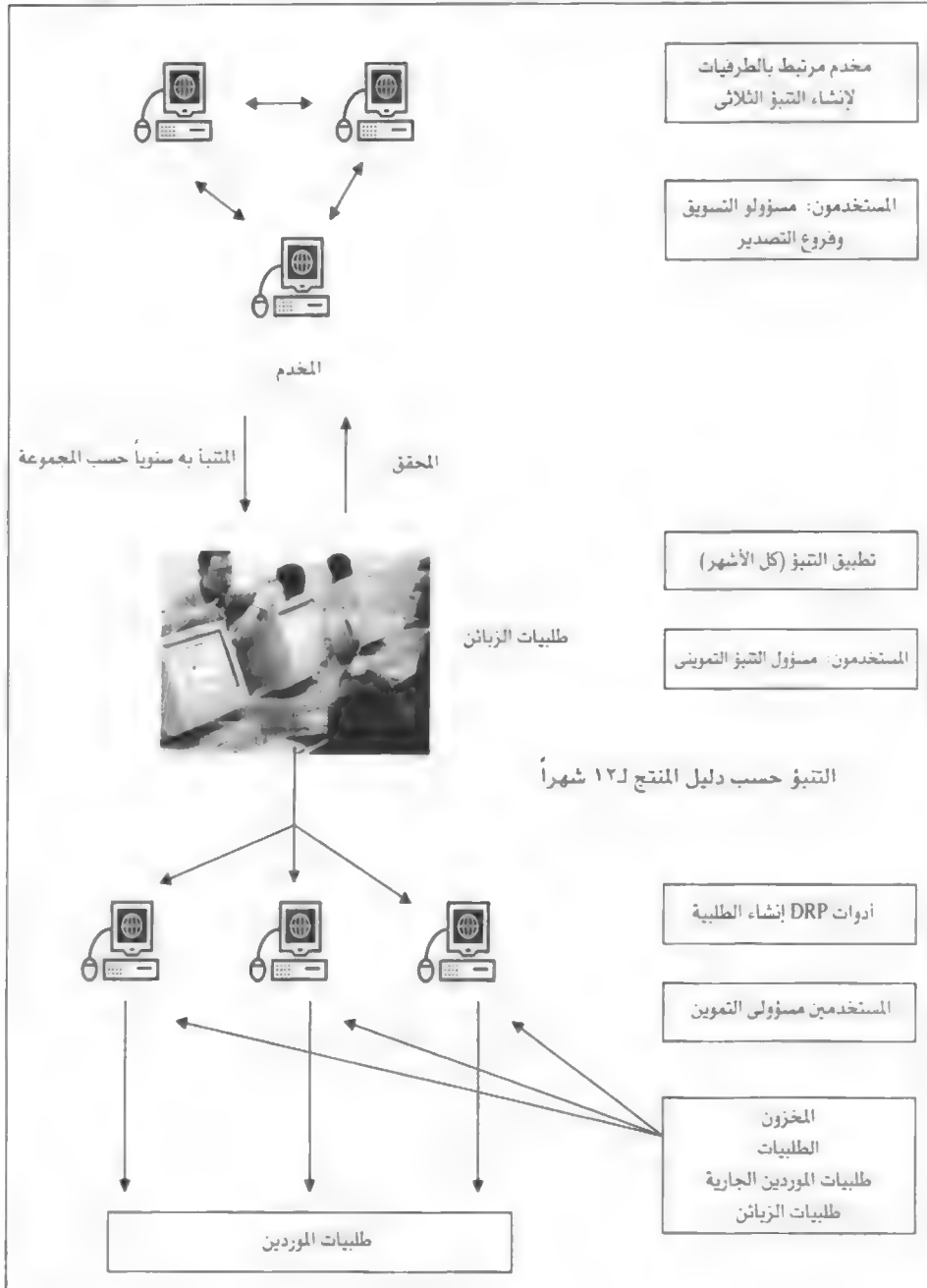
من خلال هذا المثال نكون إذن قد درسنا إنشاء شبكة إمداد وتموين متكاملة. حيث استطعنا من خلال التنبؤ المتوسط والطويل الأجل لمجموعات المنتجات المتجانسة إنشاء خطة عملية للإمداد والتموين حسب المنتج وبشكل أسبوعي (الرسم التوضيحي ١).

الرسم التوضيحي رقم (١) المعالجة المتكاملة للشبكة DRP لإكسسوارات السيارات



أخيراً يبين الرسم التوضيحي (٢) عملية توزيع المسؤوليات بين التسويق والإمداد والتموين، كذلك عملية الاتصال وتبادل المعلومات بين هذه الخدمات.

## الرسم التوضيحي رقم (٢) التوزيع الخاص لخدمات التسويق والإمداد والتمويل



## الفصل السابع

### المنتجات ذات الاستهلاك الكبير (١)

#### دورة حياة المنتج والمرونة

تعتبر السلع ذات الاستهلاك الكبير المجال الأساس والمناسب لتطبيق المفاهيم النظرية والعملية للتسويق. ولما كان هدف مدير المنتج الحفاظ على حصته في السوق والعمل على زيادتها فإن الوسائل المتاحة لجمع المعلومات عن هذه السلع (دراسة السوق، استطلاعات الرأي، ... إلخ) تعتبر على درجة كبيرة من الأهمية، ويمكن من خلالها شرح ما يحصل في أسواق هذه المنتجات، سواء بالنسبة للمستهلكين أو بالنسبة للموزعين والمنافسين وبشكل أفضل من قطاعات السلع الأخرى.

إن الانتقاد لعمليات التأثير في الأسعار من خلال الإعلان والدعاية الموجهين غالباً للشركات الكبرى لسلع الاستهلاك الكبير المعتمدة كثيراً على التسويق، يمثل حقيقة مهمة بالنسبة لنا في مجال التنبؤ. فالمنتجات ذات الاستهلاك الكبير تتعلق بالحاجات الأساسية للمستهلك من غذاء وصحة عامة ونظافة منزلية ... إلخ. وهذا الاستهلاك، الثابت إلى حد ما، لا يخضع لأي مؤثرات في السوق من قبل الصانع وإنما يتأثر فقط بالعوامل الفصلية، لذلك فإن نظرية دورة حياة المنتج تسمح لنا بتتبع تطور المنتج عبر مراحل المختلفة انطلاقاً من مرحلة طرح المنتج في السوق وانتهاءً بمرحلة اختفائه الكلي من السوق (الفقرة ١).

لا يجب الاستنتاج مما سبق أن التنبؤ لهذه المنتجات يتم بدون عراقيل، بل على العكس من ذلك فإن التأثيرات التسويقية للمنشأة ومنافسيها (الحملات الإعلانية، الترويج للمبيعات، الارتفاعات في الأسعار، ...) تؤدي إلى تقلبات مهمة تخفى معها ثبات الاستهلاك. ومن ثم يكون ضرورياً، بالنسبة لهذه المنتجات، الأخذ بعين الاعتبار المتغيرات المتعلقة بالبيئة التسويقية وإدخالها في النموذج المستخدم للتنبؤ.

هذا الإدخال للمتغيرات التفسيرية ذات الطبيعة التسويقية يمكن أن يتم من خلال شرح الانحرافات بين السلاسل المصقولة والسلاسل الخام. فاختصاصيو المنتج

يفسرون الانحرافات غير المشروحة لمسار زمنى ما بواسطة الأحداث الحاصلة فى الفترة نفسها عبر تقييم تأثيراتها الممكنة. هذه الآلية فى المعالجة توفق بين طريقة داخلية مستتدة إلى الصقل الآسى وطريقة تفسيرية حدسية. بالمقابل هناك طريقة أخرى للتنبؤ بالسلع ذات الاستهلاك الكبير تقضى باستخدام النماذج الاقتصادية القياسية لمتغيرات المزيج التسويقى Marketing mix. هذه الطريقة وكذلك التحليل المستتدة إليه (دراسة تأثير الارتفاعات فى التسعير، البحث عن الفعالية للاستثمارات الدعاية ولترويج المبيعات) ستكون موضوع الفقرة (٢).

تخصص الفقرة (٣) لمسألة التنبؤ الأسبوعى ونعرض من خلالها وبإيجاز مخططاً لنظام التنبؤ المتكامل فى قطاع الغذاء الزراعى.

أخيراً، نعالج فى الفقرة (٤) مفهوماً مهماً جداً فى مجال السلع ذات الاستهلاك الكبير وهو مفهوم المرونة حيث يسمح هذه المفهوم بقياس التأثير الناتج عن التقلبات فى متغيرات المزيج التسويقى فى المبيعات. نتهى هذا الفصل بعرض للدراسات والنماذج المتعلقة بمرونة الطلب السعرية وتأثير الدعاية وعمليات الترويج للمبيعات.

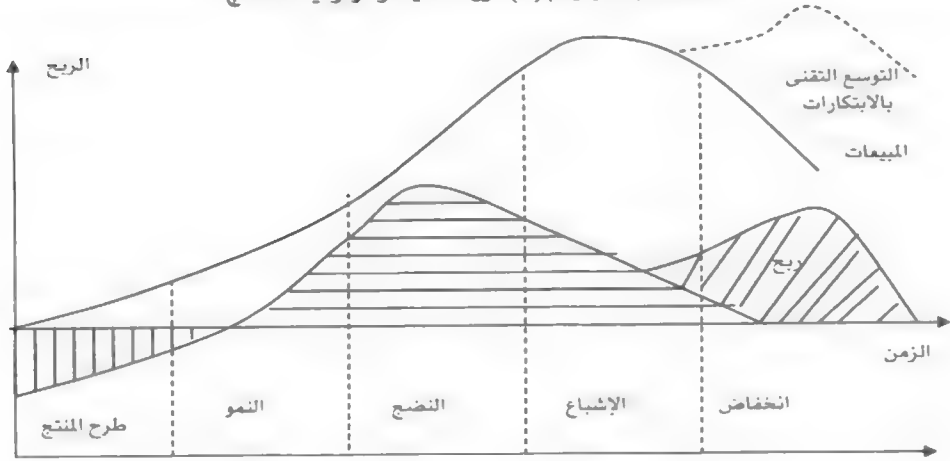
## ١- دورة حياة المنتج:

### ١-١- عرض المسألة:

يبين الشكل البيانى (١) مفهوم دورة حياة المنتج<sup>(١)</sup>. ونلاحظ من خلاله تحرك المبيعات مع الزمن، فالبداية نسبياً بطيئة مع المنتج الجديد، ثم تزداد هذه المبيعات بشكل كبير إلى أن يمر المنحنى بنقطة انعطاف اعتباراً منها يبدأ الانخفاض فى المبيعات. هذه المرحلة (مرحلة النضج) حيث يتحقق الجزء الأساس من الأرباح تنتهى بقيمة عظمتى، وبعد ذلك تبدأ المبيعات (وليس فقط إيقاعها المتزايد) بالانحدار.

(١) المفهوم المعروف هنا حول دورة حياة المنتج يطبق على المنتجات الواردة فى هذا الفصل، وكذلك على المنتجات الواردة فى الفصول السابقة.

الشكل البياني رقم (١) دورة الحياة ومردودية المنتج



- هذا السيناريو لحياة المنتج كما هو موصوف عبر منحنى الحياة ليس إلا تمثيلاً وسطياً. فيمكننا أن نجد اختلافاً كبيراً في دورات حياة المنتجات وذلك تبعاً:
- للفترة الإجمالية من تاريخ طرح المنتج حتى الوصول إلى سحبه من السوق.
  - للفترة المتوسطة لكل مرحلة.
  - لانعكاس الإصلاحات التي تتم على المنتج أو على طريقة عرضه.

تعنى النقطة الأخيرة أن مواصفات المنتج خلال دورة حياته لا يمكن أن تبقى دون تغيير، فعادة ما تكون مرحلة طرح المنتج في السوق طويلة بسبب عدم مناسبة مواصفات المنتج، وإن بشكل جزئي، لرغبات المستهلك كشكل العبوة أو محتواها ... إلخ. ومن ثم من الأجدر بنا اعتبار المنتج الذي تكون مواصفاته الأساسية مثل الاسم، النوع، المكونات الأساسية، ... إلخ بدون تعديل.

من خلال ما سبق يتضح وجود أشكال مختلفة للمنحنى الممثل لدورة حياة المنتجات. فبالإضافة إلى الشكل النمطي المعروض في الشكل (١) هناك أشكال أخرى مختلفة بشكل كبير (الشكل البياني ٢).

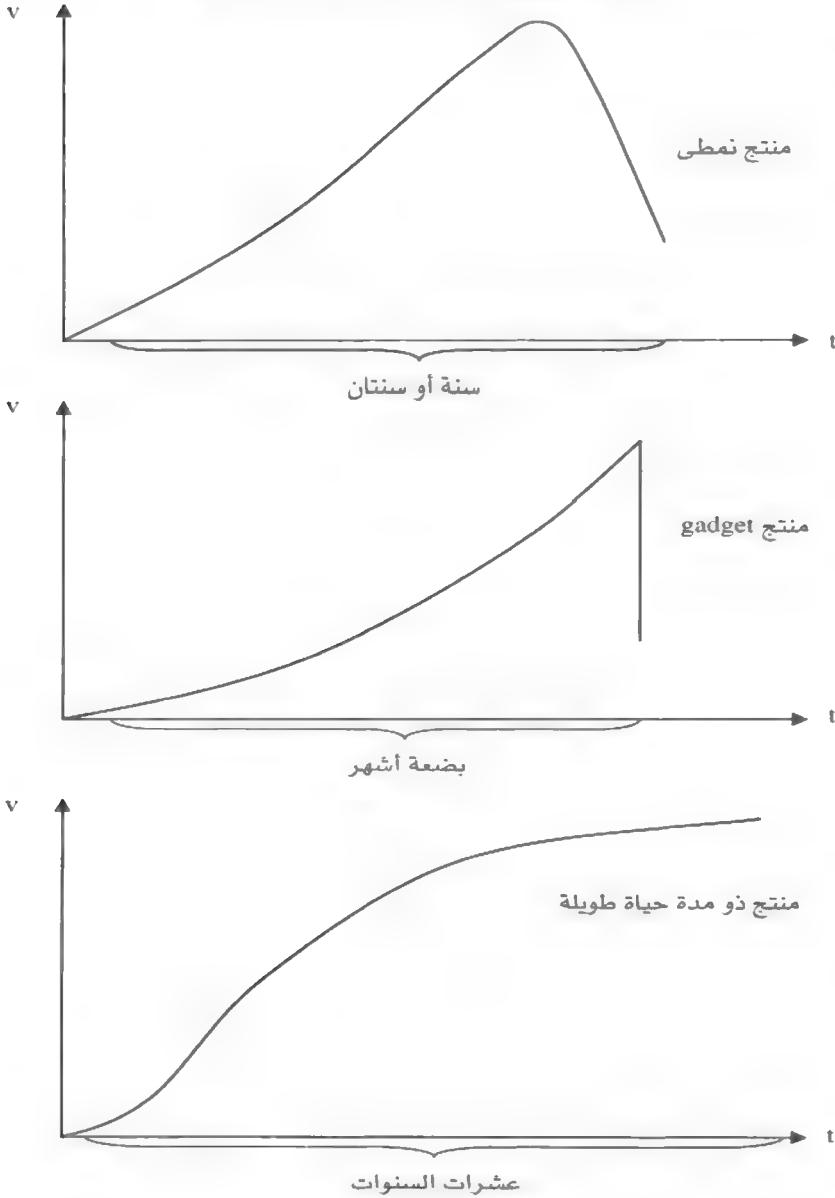
يجب على الطرائق التنبؤية المستخدمة أن تكون مناسبة لمرحلة دورة الحياة ولطولها المحتمل. فمن أجل المنتج المسمى gadget أو منتج الأداة<sup>(١)</sup> على سبيل المثال يكون

(١) المقصود بالمنتج gadget ذلك المنتج الذي، يتم إضافة بعض النصوص والرسوم عليه بشكل كبير رغبة في زيادة ترويجه، بحيث يبدو منتجاً جديداً ولكن في الغالب غير مفيد. «الترجم».



السؤال هو متى سيحصل الانخفاض الكلي للمبيعات الناتج عن انعدام الفائدة المرجوة من المنتج من قبل المستهلكين.

الشكل البياني رقم (٢) تصنيف منحنيات حياة المنتج



تعتبر كمية المعلومات المتاحة معياراً أساسياً لاختيار طريقة التنبؤ المناسبة، ففي مرحلة طرح المنتج إلى السوق، وفي حال توافر معلومات لبضعة أشهر فقط، فإن كل تنبؤ كمى للمبيعات يكون صعباً جداً؛ لأنه فى بداية المنتج يكون هناك تغيرات مهمة ومفاجئة، ومن ثم فإن تطبيق طرائق تحليل البيانات السابقة يقود إلى تنبؤات غير صحيحة لهذه التغيرات. وهكذا فإن الطريقة الكمية للتنبؤ بالمنتج فى مرحلة طرحه فى السوق يمكن أن تقود إلى تقديرات غير صحيحة للمبيعات المستقبلية.

يعتبر الكشف عن التغيرات أو التقلبات فى مراحل حياة المنتج من الأمور المهمة لعمل التنبؤ.

## ١-٢- نماذج منحنى حياة المنتج:

كثيرة هى نماذج منحنى الحياة (وكذلك نماذج الانتشار les modèles de diffusion) وتشكل مجالاً لكثير من الأعمال البحثية<sup>(١)</sup>. يمكننا التمييز بين ثلاثة أجيال من هذه النماذج:

- الجيل الأول: يشمل أكثر النماذج ويتم تحديد التطور الممكن للمبيعات من خلال معرفة درجة الإشباع. من هذه النماذج نذكر نموذج Gompertz والنموذج المنطقى اللذين سنأتى على شرحهما لاحقاً.
  - الجيل الثانى: يتم فيه إيجاد النموذج المشترك للسوق الإجمالى والسوق المحتمل للمبيعات فى اللحظة  $t$ . ومن ثم فإن العلاقات المستخدمة تصبح أكثر تعقيداً ويمكن أن نذكر هنا مثلاً لهذا النوع من النماذج، نموذج Chow ونموذج Lackman ونموذج Mahajan-Peterson.
  - الجيل الثالث لا يفترض بشكل مسبق ثبات السوق الكلى.
- سنستعرض هنا اثنين من النماذج الأساسية لمنحنى الحياة.

(١) رغم اختلاف نماذج الانتشار عن نماذج دورة الحياة إلا أنها تنتمى إليها. فبينما نمثل على محور العيانات مبيعات المنشأة وعلى محور السينات الزمن فى نماذج دورة الحياة، فإننا نمثل تراكم المبيعات للمنشأة أو للسوق على محور العيانات والزمن على محور السينات فى نماذج الانتشار. حقيقة واحدة لكلا النموذجين وهى إشباع السوق الأجل. وهذا ما يشرح استخدام كلا النموذجين للعلاقات الرياضية نفسها. يمكن العودة إلى مقالات Day, Harrell et Taylor, Tigert et Farivar. وكذلك الإسهامات الأخرى فى العدد الخاص من مجلة Journal of Marketing لعام ١٩٨١ المخصص لدورة حياة المنتج.

- نموذج Gompertz:

العلاقة الرياضية المثلة لهذا النموذج هي التالية:

$$y_t = e^{br^t + a}$$

أو على الشكل:  $\text{Log} y_t = a + br^t$  مع اعتبار  $0 < r < 1$  وحيث:

$\text{Log} y_t$ : اللوغاريتم النيبيري للمبيعات في الزمن  $t$ .

$a, b, r$ : معاملات النموذج.

يمكننا ملاحظة الخصائص التالية:

إذا  $t \rightarrow -\infty$  فإن  $y_t \rightarrow 0$  في حال  $b < 0$ :

إذا  $t \rightarrow \infty$  فإن  $y_t \rightarrow e^a$  (تمثل  $e$  أساس اللوغاريتم النيبيري).

إذن نحن بصدد نموذج رياضي له شكل حرف S، أي إنه يزداد بشكل سريع ثم يتناقص بعد نقطة انعطاف. وهذا يمثل التطور النمطي للمبيعات من سلعة ما، حيث تكون المبيعات معدومة في البداية ( $t = 0$ ) ثم تصل إلى الإشباع عند ( $t \rightarrow \infty$ ).

يعبر المعامل  $r$  عن سرعة العملية، فكلما صغر هذا المعامل تم الوصول إلى الإشباع بشكل أسرع. ويمثل المعامل  $a$  درجة الإشباع (الدرجة تساوي  $e^a$ ). وأخيراً يرتبط المعامل  $b$  بنقطة الأصل.

نقطة الانعطاف لمنحنى الحياة ثابتة، ويتم الوصول إليها عندما تبلغ المبيعات المتراكمة (٣٦,٨٪) من درجة الإشباع  $e^a$ .

- النموذج المنطقي<sup>(١)</sup>:

يعبر عن هذا النموذج بالعلاقة التالية:

$$y_t = \frac{y_{max}}{1 + br^t}$$

حيث:

$y_{max}$ : درجة الإشباع.

$a$  و  $r$  المعاملات المميزة للنموذج ( $-1 < r < 0$ ).

(١) هذا النموذج سبق أن تم عرضه في الفصل السادس.

خصائص النموذج هي التالية:

$$\text{إذا } t \rightarrow -\infty \text{ فإن } y_t \rightarrow 0$$

$$\text{إذا } t \rightarrow \infty \text{ فإن } y_t \rightarrow y_{max}$$

نقطة الانعطاف للمنحنى ثابتة، ويتم الوصول إليها عندما تبلغ المبيعات المتراكمة (٥٠٪) من درجة الإشباع  $y_{max}$ .

### ٣-١- طرائق التقدير:

المشكلة التي تواجه تقدير هذا النوع من النماذج هي في كونها نماذج غير خطية، ومن ثم فإن استخدام نماذج الانحدار الخطى يبدو غير ممكن. ولكن من الممكن جعل النموذج خطياً عندما نعلم أو بالأحرى نفترض قيمة درجة الإشباع (حيث لا يمكننا أبداً معرفتها). ومن ثم فإنه يمكننا تمييز عدة طرائق لتقدير هذا النمط من النماذج:

- الطرائق الحدسية التي نضع من خلالها فرضيات حول قيم درجة الإشباع.

- الطرائق الرياضية البحتة لحل مجموعة من المعادلات غير الخطية.

- جعل النموذج خطياً باستخدام قيمة مقدرة لدرجة الإشباع:

- نموذج Gompertz:

$$y_t = e^{br^t + a} = e^{br^t} \times e^a \rightarrow \frac{e^a}{y_t} = e^{-br^t}$$

$$\ln\left(\frac{e^a}{y_t}\right) = -b r^t \rightarrow \ln\left[\ln\left(\frac{e^a}{y_t}\right)\right] = \ln(-b) + t \ln(r) \rightarrow Y_t = a_0 + a_1 t$$

$$\ln\left[\ln\left(\frac{e^a}{y_t}\right)\right] = Y_t; \quad \ln(-b) = a_0; \quad \ln(r) = a_1 \quad \text{باعتبار}$$

ومن ثم فنحن أمام نموذج خطى للانحدار البسيط على الزمن، ومن ثم يتوجب

$$Y_t = \ln\left[\ln\left(\frac{e^a}{y_t}\right)\right] \quad \text{علينا أن نحسب من جديد المتغير الواجب تفسيره:}$$

- النموذج المنطقي:

$$y_t = \frac{y_{\max}}{1 + br^t} \rightarrow \frac{y_{\max}}{y_t} = 1 + br^t \rightarrow \frac{y_{\max}}{y_t} - 1 = br^t$$

$$\ln \left( \frac{y_{\max}}{y_t} - 1 \right) = \ln(b) + t \ln(r) \rightarrow Y_t = a_0 + a_1 t$$

$$\ln \left( \frac{y_{\max}}{y_t} - 1 \right) = Y_t; \ln(b) = a_0; \ln(r) = a_1 \text{ باعتبار:}$$

ومن ثم فنحن أمام نموذج خطي للانحدار البسيط على الزمن، فيتوجب علينا

$$Y_t = \ln \left( \frac{y_{\max}}{y_t} - 1 \right) \text{ حساب المتغير الواجب تفسيره:}$$

يمكن تقدير درجة الإشباع للمنتج المدروس بالتشابه مع منتج آخر مشابه له، ولكن مرحلة طرحه في السوق أقدم. يمكننا على سبيل المثال الاستعانة بسوق التلفزيون للحصول على معلومات حول درجة الإشباع لأجهزة الفيديو. كما يمكننا اللجوء إلى عملية التشابه الجغرافي بالاستناد إلى سوق أكثر تقدماً للمنتج نفسه كما هو الحال عند مقارنة السوق الفرنسي بالسوق الأميركي على سبيل المثال.

- الطرائق الرياضية التحليلية:

التقدير للمعاملات الثلاثة الظاهرة في نموذج Gompertz وفي النموذج المنطقي يمكن أن تتم من خلال الاستعانة بطرائق الانحدار غير الخطية التي تستلزم طرائق تحليل عددية تكرارية معقدة إلى حد ما. ولكن يمكننا من خلال استخدام الأداة "SOLVEUR" من البرنامج إكسل إيجاد التقدير لهذه المعاملات، مهما كان شكل النموذج غير الخطي. لن ندخل في هذه التفاصيل الرياضية ويمكن للقارئ المهتم العودة إلى المراجع المشار إليها في نهاية الكتاب<sup>(١)</sup> وسنعرض في الفقرة القادمة مثالا لاستخدام هذه الطرائق.

#### ١-٤- مثال لتحديد النموذج وتقدير المعاملات:

الجدول رقم (١) يبين معدل التزود بأجهزة الفيديو للأسر في فرنسا من العام ١٩٧٩ إلى العام ١٩٩٧.

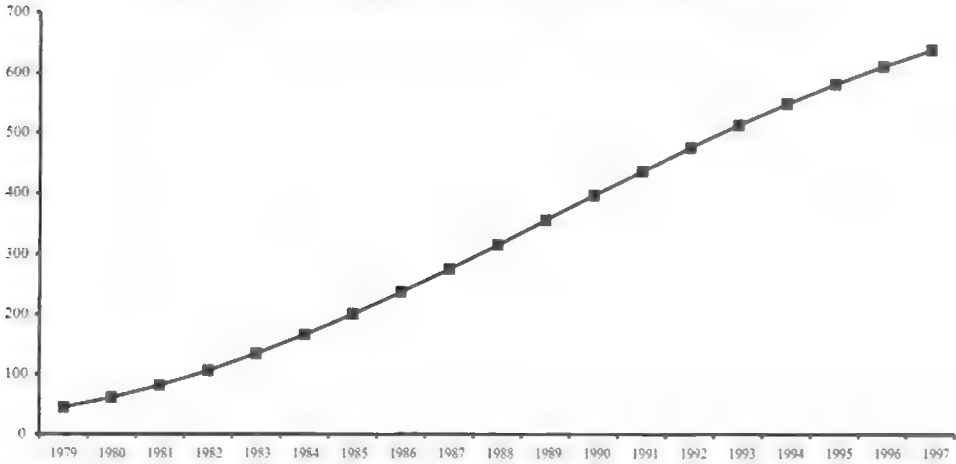
(١) Bourbonnais (٢٠٠٠) الفصل السادس.

الجدول رقم (١) معدل التزود (لكل ١٠٠٠ من الأسر) بأجهزة الفيديو (الملف C7EX1.XLS)

السنة	المعدل	السنة	المعدل	السنة	المعدل
١٩٧٩	٤٤,٧	١٩٨٦	٢٣٦,٩	١٩٩٣	٥١٠,١
١٩٨٠	٦١,٠	١٩٨٧	٢٧٥,٤	١٩٩٤	٥٤٤,٩
١٩٨١	٨١,٢	١٩٨٨	٣١٥,٠	١٩٩٥	٥٧٧,٢
١٩٨٢	١٠٥,٨	١٩٨٩	٣٥٥,٢	١٩٩٦	٦٠٧,٠
١٩٨٣	١٣٤,٠	١٩٩٠	٣٩٥,٣	١٩٩٧	٦٣٣,٩
١٩٨٤	١٦٥,٦	١٩٩١	٤٣٤,٨		
١٩٨٥	٢٠٠,١	١٩٩٢	٤٧٣,٣		

كما يبين الشكل البياني رقم (١) تطور معدل تزود الأسر بأجهزة الفيديو تبعاً لسنوات الدراسة. وهذا التمثيل البياني يمكن أن يوحى بتطور يمكن تمثيله بواسطة نموذج الانتشار Modèle de diffusion، ومن ثم نكون بالقرب من نقطة انعطاف.

الشكل البياني رقم (٣) معدل التزود بالفيديو (لكل ألف من الأسر)



ومن خلال التدقيق في البيانات يمكن القول بأنها تتوافق مع نموذج Gompertz أو النموذج المنطقي: إذ سنعمل على تقدير معاملات هذه النماذج مع الأخذ بعين الاعتبار التشابه مع سوق الولايات المتحدة، ومن ثم الافتراض أن معدل الإشباع أو التزود الأعظمي يساوي (٨٠٠) لكل (١٠٠٠) من السكان.

- نموذج Gompertz:

من أجل تقدير معاملات النموذج حيث  $e^a = 800$  سنعمل على جعل التابع  $y_t = e^{br^t+a}$  خطياً. أى سنحسب قيم المتغير الجديد الواجب تفسيره:

$$Y_t = \ln \left[ \ln \left( \frac{e^a}{y_t} \right) \right] = \ln \left[ \ln \left( \frac{800}{TAUX_t} \right) \right]$$

نتائج تقدير الانحدار على الزمن  $t$  من (١) إلى (١٩) هى التالية:

$$Y_t = 1.27 - 0.139t$$

$$R^2 = 0.99$$

ومن ثم فإن النموذج المقدر هو:

$$y_t = e^{br^t+a} = e^{(-12.47 \times 0.87^t + 2.90)}$$

حيث:  $-12.47 = -e^{\hat{a}_0} = -e^{2.523} = -12.47$  و  $\hat{b} = -e^{-0.139} = 0.87$  و  $\hat{r} = -e^{\hat{a}_1} = -e^{2.90} = 800$

- النموذج المنطقى:

من أجل تقدير معاملات النموذج حيث  $y_{max} = 800$  سنعمل على جعل التابع

$$y_t = \frac{y_{max}}{1 + br^t} \text{ خطياً.}$$

أى سنحسب قيم المتغير الجديد الواجب تفسيره:

$$Y_t = \ln \left( \frac{y_{max}}{y_t} - 1 \right) = \ln \left( \frac{800}{TAUX_t} - 1 \right)$$

نتائج تقدير الانحدار على الزمن  $t$  من (١) إلى (١٩) هى التالية:

$$Y_t = 2.78 - 0.224t$$

$$R^2 = 0.99$$

الجودة الإحصائية للنموذج جيدة ومن ثم فإن النموذج المقدر هو التالى:

$$y_t = \frac{y_{max}}{1 + br^t} = \frac{800}{1 + 16.250 \times 0.7988^t}$$

حيث:  $\hat{r} = -e^{\hat{a}1} = -e^{-0.224} = 0.7988$  و  $\hat{b} = -e^{\hat{a}0} = -e^{2.788} = -16.25$

يعطى استخدام الحل التحليلي بواسطة الأداة Solveur النتائج التالية:

من أجل نموذج Gompertz:  $y_t = e^{br^t+a} = e^{(-3.46 \times 0.88^t + 6.83)}$  وتكون درجة الإشباع مساوية لـ (٩٢٧) (مع مجموع مربعات الانحرافات المساوى لـ ٢٤٠.٠٩).

من أجل النموذج المنطقى:  $y_t = \frac{y_{max}}{1 + br^t} = \frac{718}{1 + 14.77 \times 0.784^t}$  وتكون درجة الإشباع مساوية لـ (٧١٨) (مع مجموع مربعات الانحرافات المساوية لـ ٦٩٨.٥٠).

يعتبر نموذج Gompertz أفضل لأن مجموع مربعات الانحرافات أقل بكثير من النموذج المنطقى.

يشير المثال المعالج هنا إلى محدودية استخدام منحنيات الحياة للأسباب التالية:

- الطريقة الصارمة فى تعريف النموذج والمحددة بشكل مسبق.
- اختيار شكل النموذج يؤثر فى النتائج.

من جهة أخرى الفائدة من هذه الطريقة هى فى محاولة تحديد الانقطاعات فى دورة حياة المنتج وكذلك استخلاص النتائج تبعاً للحدث. بالإضافة إلى ذلك، فى إطار مرحلة طرح منتجات جديدة يكون أحياناً مفيداً إجراء تحليلات مقارنة لمعاملات منحنى الحياة مع منتجات تم طرحها فيما بعد. فهى تسمح بتقييم سريع لاحتمال دخول منتجات جديدة.

## ٢- إدخال مكونات المزيج التسويقي Marketing mix:

لو أردنا أن نكون أكثر شمولية، لأخذنا بعين الاعتبار مكونات المزيج التسويقي التالية:

- المنتج.
- السعر.
- مكان التوزيع (منظومة التوزيع).
- ترويج المبيعات (دعاية، تخفيضات، إغراءات، ... إلخ).

نحن نأخذ بعين الاعتبار مرحلة حياة المنتج دون الخصائص النوعية لذلك المنتج، ومن ثم فنحن ملزمون باعتبار أن كل المنتجات المنافسة متساوية أى لها النتيجة نفسها على مجمل صفاتها.



لقد تم دراسة موضوع تأثير الجودة فى المبيعات من منتج ما من قبل الكثير من الباحثين<sup>(١)</sup> وهذا التأثير يظهر أكثر فى تقييم أسباب النجاح أو الفشل منه فى التنبؤ.

أما بخصوص السعر الذى يعتبر متغيراً محدداً فإن التأثير للارتفاعات فى التعرفة، المدروسة فى الفقرة (٢-١) من هذا الفصل، يجب أن يكون مختلفاً تبعاً لكونه يتعلق بشرح المبيعات على مستوى حلقات التوزيع أو على مستوى المستهلكين.

أما بالنسبة للموزع فإنه يراقب الانخفاض فى الأسعار الاسمية، وهو بطبيعته سيسعى إلى الحصول على التموين من مختلف البضائع بالأسعار الدنيا، ومن ثم فلدیه نزعة كبيرة للشراء على أثر الإعلان عن ارتفاع فى التعرفة. فإذا كان لهذه الأخيرة تأثير فوري (بدون مهلة زمنية بين الإعلان وتطبيقه) فسيكون التأثير غير موجود، ومن ثم فإن المتغير الواجب تفسيره هو متغير الفروقات الأولية للأسعار.

بالنسبة للمستهلك فإنه يشتري بكميات كبيرة من السلع المختلفة، وتكون قدرته على الاهتمام والإصغاء لحال السوق محدودة بسبب الوقت، وبسبب كون الجهود التى يمكن أن يكرسها لإجراء المقارنات بين أسعار السلع المنافسة وشرح آلية تطورها مع الزمن يمثل تكلفة يمكن أن تكون أكبر من الوفر الذى يمكن الحصول عليه من جراء هذه المقارنات بين الأسعار.

يمكننا الافتراض أن درجة حساسية المشتري للسعر أخفض بشكل واضح من تلك الخاصة بالموزع. فالمستهلك لا يتفاعل إلا عندما تكون الأسعار أعلى بشكل واضح من المستوى المتوسط الممثل للتضخم.

بالنسبة للعناصر المرتبطة بالتوزيع (منظومة التوزيع) فلا يمكن إدخالها فى نظام التنبؤ قصير الأجل إلا بصعوبة كبيرة كونها غالباً ذات طبيعة نوعية ومعقدة.

بالمقابل فإن المكونات المرتبطة بترويج المبيعات يمكن إدخالها فى النموذج التفسيري للمبيعات، حيث تمثل أهمية كبيرة للمنشأة وتعتبر متغيرات نستطيع عبرها التحرك بسرعة كبيرة (وهذا ليس الحال بالنسبة للتوزيع الذى يحتاج غالباً إلى فترات طويلة ليتم تعديله). بالإضافة إلى ذلك، فإن مكونات ترويج المبيعات المعبر عنها فى الميزانية الاستثمارية للدعاية والإعلان بالوحدات النقدية المحلية يمكن وبسهولة تحديدها كمياً.

(١) Zeithaml (١٩٨٨).

يتم اعتبار الاستثمار فى مجال الدعاية من خلال:

- إما الاستثمارات التى تخصصها المنشأة للدعاية والإعلان.
- وإما من خلال المقياس SECODIP للاستثمار الإجمالى فى مجال الدعاية الإجمالية المتضمن استثمارات المنافسين. وهذه الاستثمارات تتعلق بتخصيص كتلة فى الميزانية للاستثمارات فى مجال الدعاية والإعلان عبر إحدى الوسائل الإعلانية.
- أما المركبة الخاصة بعملية الترويج للمبيعات فإن إدخالها فى نموذج التنبؤ يعتبر صعباً بسبب عدم تجانسه ويمكن أن تشمل:
- النفقات على المواد: PLV. كوبونات التوزيع.
- تخفيضات للموزعين حسب الحملة الإعلانية أو بشكل سنوى وأحياناً حسب المناطق.
- هدايا، حسومات أو ألعاب من قبل الموزعين.
- تخفيضات كمية (وحدة مجانية عند شراء ثلاثة).
- جوائز، عينات مجانية، مسابقات، ... إلخ

يمكن ضبط هذا المتغير ذى المركبات المختلفة بطريقتين:

- إما بسلسلة زمنية وحيدة بحيث تكون مقيمة ومجمعة وفق تكلفة كل عنصر فيها. وهذا يفترض أن كل وحدة نقدية صرفت فى شكل خاص من أشكال الترويج لها المردود الهامشى نفسه.
- وإما بواسطة المتغيرات الترميزية ( = بدون ترويج، و ١ = فترة ترويج) لكل نمط من أنماط ترويج المبيعات. يشير كل عنصر تثقيل محسوب بواسطة النموذج إلى تأثير كل عنصر من عناصر ترويج المبيعات على المبيعات (الملف C7 EX2.XLS).
- بغية القياس الصحيح لتأثير هذه المتغيرات التسويقية فى المبيعات، من المفضل سحب مركبة الاتجاه العام بشكل مسبق.
- سنعالج الآن ثلاثة مظاهر تم ترتيبها على النحو التالى:
- ارتفاع الأسعار الذى يحتل المرتبة الأولى فى شرح التقلبات لبعض السلاسل المستخدمة فى مجال السلع الاستهلاكية.
- مشكلة الخلط الذى يمكن أن يحصل بين المركبة الفصلية ووسائل ترويج المبيعات.
- التنبؤ للسلع ذات الاستهلاك الكبير والتميزة بتأثير ضعيف للتسويق.

## ٢-١- كيف يقاس تأثير ارتفاع الأسعار؟

غالباً ما تلجأ المنشآت إلى زيادة تعرفه منتجاتها في فترة محددة، مرة أو مرتين كل عام، على سبيل المثال في شهر كانون الثاني وتموز. ولأن هذه القرارات تحصل بفترات ثابتة فمن الممكن أن نقع في مشكلة الخلط ما بين هذه التأثيرات والمعاملات الفصلية الشهرية. فإذا غيرت المنشأة فيما بعد هذه التواريخ لرفع أسعارها فإن التنبؤ سيكون خاطئاً بشكل كامل. ومن ثم يجب فصل تحليل المركبة الفصلية عن تحليل تأثير ارتفاع الأسعار.

## - توقيت الزيادة في الشهر ومجال التأثير:

لا تعتبر الزيادة بالتعرفة بحد ذاتها المتغير التفسيري، وإنما الإعلان عن الزيادة هو الذي يؤدي إلى رد الفعل. فإذا تم الإعلان عن الزيادة في الأسعار ففي اليوم نفسه الذي تم تطبيقها سيكون التأثير في المبيعات معدوماً، في حين أنه إذا أُعلن عنها قبل شهر فذلك سيقود إلى رد فعل مضاعف، فمن جهة سيكون هناك زيادة في المبيعات قبل تاريخ دخول الزيادة موضع التنفيذ، ومن جهة أخرى سيكون هناك حالة من امتصاص أو اختفاء في المبيعات للشهرين القادمين أو الثلاثة القادمة.

إذن السوق لم يشهد ارتفاعاً أو انخفاضاً وإنما تعديلاً في توزيع مشتريات الموزعين بين مختلف الأشهر. وللتوقيت المحدد للارتفاع ضمن الشهر أهمية كبرى، فإذا حدث في الأول من شهر شباط فإن زيادة المبيعات ستحصل في شهر كانون الثاني، وإذا حدث في (٢٠) شباط فإن الشهر نفسه سيتحمل هذا التأثير.

لقد تم إجراء دراسة على شركة كبيرة متخصصة في صناعة المشروبات الكحولية حول تأثير الارتفاع في التعرفة لخمس منتجات نرّمز لها بالرموز A, B, C, D و E. لقد كانت الفكرة أولاً دراسة جوانب التأثير لهذه السلاسل المختلفة من خلال البحث عن الارتباط بين المبيعات دون مركبة الاتجاه العام ( $V_t - T_t$ ) وبين التغييرات في الأسعار عند تأخيرات زمنية مختلفة  $(P_t - P_{t-1})_{t,0}$ .

لم يتم تخلص المبيعات  $V_t$  من المركبة الفصلية لأننا نفترض أن التأثير في ارتفاع التعرفة يكون قبل المركبة الفصلية. ولكننا بالمقابل نتخلص من مركبة الاتجاه العام  $T_t$  للحصول على سلسلة مستقرة. لقد تم أخذ الفروقات الأولية لسلسلة الأسعار  $P_t$  لأنه والحالة هذه تحسب فقط التغيرات الاسمية. يشمل ارتفاع الأسعار الزيادة في معدل الضريبة على الفئات المختلفة من المشروبات الكحولية وزيادة التعرفة دون الضريبة

للمنشأة التي تتم بالتاريخ نفسه. يعتبر معامل الارتباط بين المبيعات والتعرفة عند مختلف التأخيرات الزمنية معيار التأثير وهو يقيس درجة واتجاه العلاقة.

يبين الجدول رقم (٢) معاملات الارتباط  $\rho$  بين المبيعات عند الفترة  $t$  والتعرفة في الفترة  $t - \theta$ . وتسمح معاملات الارتباط هذه بتوضيح أوجه التأثير للتعرفة على المبيعات للمنتجات الخمسة المدروسة.

الجدول رقم (٢) أوجه التأثير للأسعار للمنتجات E, A, B, C, D

المنتج E	المنتج D	المنتج C	المنتج B	المنتج A	$\theta$
٠,٠٨٨	٠,٢٢٣	٠,٢٤٤	٠,٠٩٥-	٠,٢٩٧	٢-
٠,٤٧٨	٠,٦٥١	٠,٤٢١	٠,٧١١	٠,١٥٣	١-
٠,١٥٣-	٠,١٨٥-	٠,٢٠٥-	٠,٣١٤-	٠,٠٦٢-	٠
٠,٢٩٠-	٠,١٤٢-	٠,٠٢٥-	٠,٣٧٣-	٠,٠٠٩	١
٠,٢١٦-	٠,١٢٨	٠,٠٥٧	٠,٠٤٩-	٠,٠٥٣-	٢
٠,٢١٥-	٠,٠١٩	٠,٠٩٨	٠,١٨٠-	٠,٠٧٥	٣
٠,٠٥١-	٠,٠٥٨	٠,١٣٨	٠,١٣٤-	٠,١٦٣-	٤

يلاحظ أن الارتفاعات في التعرفة بالنسبة للمنتج A في مجملها قليلة المعنوية، وإذا اعتبرنا أن القيمة الأقل من (٠,٢) بالقيمة المطلقة لمعامل الارتباط لا تشير إلى معنوية أو دلالة إحصائية، فإن المنتج A لا يظهر إلا تأثيراً خفيفاً لزيادة في المبيعات عند التأخير  $\theta = -2$ . بالمقابل فإن التأثير للارتفاع بالتعرفة يبدو واضحاً بالنسبة للمنتجات B و E، حيث يتعلق الأمر بشكل واضح بمنتجات مخزنة بكميات كبيرة، وبشكل مسبق من قبل الموزعين، وهي التي تعرف فيما بعد تكدساً نسبياً في المبيعات. بالإجمال، التأثيرات التي تسبق المبيعات الزائدة تبدو بشكل واضح أكثر من تأثيرات التلاشي أو الاختفاء. فالمنتجات C و D رغم أن لها اتجاهاً معنوياً نحو فائض المبيعات، إلا أن لهم أيضاً اتجاهاً نحو الامتنصاص دون معنوية حقيقية إحصائية أو اقتصادية. وهذا يؤكد أنه ليس من الواضح اعتبار الارتفاعات في التعرفة متغيراً تفسيرياً يجب الأخذ به في كل الحالات، وهنا يجب اللجوء إلى مسار الارتباط الظاهر لتحديد درجة العلاقة، وكذلك التأخير أو المهلة الزمنية.

يمكن أن تعزى هذه الاختلافات، بجزء كبير منها، إلى أذواق المستهلكين ورغباتهم المختلفة، فهناك بعض المنتجات الكحولية ذات الاستهلاك العادى المتكرر ولها حجم مبيعات كبير، ومن ثم فإن الشراء الزائد منها يعتبر عملية مربحة جداً بالنسبة للموزع. ولبعض المنتجات الأخرى رقم أعمال أقل ودورة مخزون أكثر بطئاً، ومن ثم من المحتمل أن تكون المبيعات الإضافية أقل ضعفاً بالنسبة لهذه المنتجات، ولا يوجد امتصاص أو اختفاء للمخزون. الهدف من الشراء الزائد هو إعادة تكوين المخزون الذى تركناه ينخفض بشدة فى الأشهر الأخيرة، وليس تكوين مخزون كبير يمكن أن يمثل عبئاً مالياً كبيراً فى حالة الدوران الضعيف للمخزون.

- التنبؤ باعتبار الارتفاعات فى التعرف كمتغير تفسيرى فى النموذج:

يتم فى هذه الطريقة المبسطة للتقدير اعتماد الارتفاع فى التعرف كمتغير تفسيرى فى حال كان أثره واضحاً، وكذلك يتم إدخال عاملين داخليين هما متغير الفصلية ومتغير حركة الاتجاه العام. فى حالة المنتج E تم الأخذ بعين الاعتبار التأثيرين المذكورين، وتم تقدير معادلة الانحدار باستخدام التأخيرات الزمنية الموافقة للمعاملات الارتباطية ذات العلاقة المعنوية والظاهرة فى جدول اتجاهات الارتباط. نتائج التقدير هى التالية:

$$V_t - T_t = -6.93 + 16639 (P_t - P_{t-1})_{t-1} - 6.942 (P_t - P_{t-1})_{t-1} - 10174 (P_t - P_{t-1})_{t-2}$$

(0.04)                      (5.20)                      (2.12)                      (3.02)

$$R^2 = 0.82, \quad DW = 2.30, \quad n = 63, \quad (.) = t \text{ de Student}$$

يعتبر هذا النموذج صحيحاً من الناحية الإحصائية. ويعود كون معامل الحد الثابت غير معنوى إلى أن سلسلة المبيعات ليس لها مركبة اتجاه عام ومتمركزة حول القيمة صفر، فى حين أن المتغيرات الأخرى جميعها ذات دلالة إحصائية معنوية. وهناك تجانس من ناحية الإشارات إلى المعالم المقدرة، فالإشارة موجبة للفائض من المخزون  $(t-1)$  وسالبة للامتصاص  $(t, t+1, t+2)$ . وأخيراً يشير شبه التوازن بين تأثير المخزون الزائد وتأثير عدم التخزين (مجموع المعاملات يساوى تقريباً القيمة صفر) إلى أن الاستهلاك من المواد لم يتغير بواسطة السياسة التعريفية للمنشأة.

## ٢-٢- المركبة الفصلية وترويج المبيعات Promotion:

غالباً ما تبرمج المنشآت عمليات الترويج لمبيعاتها بالتواريخ نفسها من عام إلى آخر بسبب وجود بعض المناسبات والمعارض الدورية، وهذا مما لا شك فيه سيؤدى إلى خلط تأثير هذه العمليات مع تلك الخاصة بالمركبة الفصلية، ومن ثم سيكون مستحيلاً

تحديد المعاملات الفصلية الحقيقية، أى تلك المعاملات التى كان يجب أن تكون فيما لو لم يكن هناك عمليات ترويج للمبيعات. إذن نحن لا نستطيع أن نحدد من خلال المعامل الفصلية حصة عمليات الترويج وحصة المركبة الفصلية.

وما دامت المنشأة تستمر بإجراء برامج الترويج بشكل موحد ومتشابه فإنه لا مشكلة تظهر، ولكن عندما يتم تعديل التاريخ أو فى حال التخلّى عن حملة الترويج لسبب ما فإن التنبؤ سيكون خاطئاً بسبب المركبة الفصلية. ويكون من المستحيل أن نحدد بشكل مسبق معامل تصحيح نستطيع من خلاله تصحيح التنبؤات. لذلك يجب تحذير القائم على التنبؤ من هذه المسألة كى يستطيع التدخل بطريقة يدوية إما بشكل مباشر على المعاملات الفصلية (على سبيل المثال استبدال المعاملات الفصلية للمبيعات بتلك الخاصة بالسوق)، وإما بشكل مباشر على التنبؤ المحسوب. فبعد عام أو اثنين أو بعد فترة أو فترتين حيث يتم خلالهما ترويج المبيعات بأزمة مختلفة، يمكن للمعاملات الفصلية أن تكون مستخدمة مباشرة، ويكون التنبؤ المحسوب قد أخذ بعين الاعتبار الأزمة الجديدة لترويج المبيعات.

## ٢-٣- التنبؤ للمنتجات ذات الضغط التسويقي الضعيف:

هناك جمود كبير فى مبيعات بعض المنتجات الاستهلاكية وتتميز هذه المنتجات بالخصائص التالية:

- القدم.
- حالات التجديد المتكررة.
- السعر الضعيف.
- على الأغلب من الضرورات الأولية وذات الاستهلاك الدارج.

كل هذه الخصائص تجعل المسار الزمنى لهذه المنتجات قليل التأثير بالبيئة الاقتصادية العامة وبالساسة التسويقية للمنشأة (السعر، الدعاية، ترويج المبيعات، ...). والمبيعات تتحقق تبعاً لاسم المنتج ولفائدته.

من المنتجات التى تنتمى إلى هذه الفئة نذكر المنتجات ذات الاستخدام المنزلى مثل السكر، وماء جافيل، واللمبات الكهربائية، ... إلخ).

عند مواجهة القائم على التنبؤ لهذا النوع من المنتجات فإن عمله فى هذه الحالة يعتبر بسيطاً وميسراً. ومع ذلك يمكنه تحسين تنبؤاته من خلال إدخال بعض المتغيرات مثل الساسة الترويجية للمنشأة أو التأثيرات الخارجية المتوقعة ضمن إطار المنشأة نفسها.

التقنية المستخدمة للتنبؤ في هذه الحالة هي الصقل الآسي (نموذج Holt-Winters) مع إمكانية التعديل الأوتوماتيكي للتنبؤ الحاصل من خلال إدخال عنصر تفسيرى ما. ويكون دور ذلك العنصر تصحيح التنبؤ تبعاً لنسبة مئوية مرغوب فيها (أكثر أو أقل) حول تطور المبيعات. ومثالاً على تلك التقنية واستخدامها في مجال ترويج المبيعات، يمكن النظر إلى الملف C7 EX3.XLS.

تتميز هذه الطريقة ببساطة إدارتها مما يبرر استخدامها من قبل القائم على التنبؤ عندما يواجه عدداً كبيراً من المنتجات.

### ٣- التنبؤ الأسبوعى: حالة المنتجات الطازجة:

في قطاع السلع ذات الاستهلاك الكبير وبشكل خاص في مجال السلع الغذائية تعتبر دورة حياة المنتج وشروط تقديمه بشكل طازج سبباً موجباً لإعداد التنبؤات خلال فترة أسبوع. وإن اعتماد عملية تقسيم التنبؤات الشهرية إلى أسابيع يقود إلى سلبية تتمثل في محى المركبات الفصلية الخاصة بالأسبوع وإلى الالتزام بإدارة تقويم شهرى - أسبوعى. بالإضافة إلى ذلك، فإن معظم الأنشطة المتعلقة بالتسويق أو بالترويج للمبيعات يتم التخطيط لها بشكل أسبوعى ومن ثم فإن لها تأثيراً في المبيعات الأسبوعية.

#### ٣-١- طريقة التنبؤ الأسبوعى:

لكى نستطيع حساب المعاملات الفصلية الأسبوعية، نحتاج إلى سلسلة زمنية للمبيعات لا تقل عن ثلاث سنوات من المبيعات الأسبوعية، أى ما يعادل (١٥٦) مشاهدة. الأدوات الإحصائية المستخدمة هي نفسها المستخدمة بالنسبة لحساب التنبؤ الشهرى، ولكنها تتلاءم مع المعطيات الأسبوعية.

#### - تصحيح أيام العمل وتحليل المركبة الفصلية:

يعتبر تصحيح أيام العمل الفعلية ذا أهمية كبيرة في حالة المعطيات الأسبوعية، فالتأثير ليوم عطلة على المبيعات الأسبوعية يجب أن يأخذ بعين الاعتبار وبشكل خاص عندما يكون هناك وصل أو «جسر» ما بين يوم العطلة ويوم آخر. يتم التصحيح بطريقة اعتيادية، فإذا اعتبرنا أن الأسبوع المتوسط يتكون من ستة أيام استهلاكية (أحياناً سبعة أيام) فإننا نطبق معامل تصحيح وفقاً لعدد أيام العمل الفعلية. يمكن أيضاً تحسين عملية التصحيح من خلال اعتماد معاملات تصحيحية مختلفة تبعاً ليوم العطلة. فعلى سبيل المثال يكون ليوم الاثنين العطلة (-١٠٪) تأثير أقل من يوم الجمعة العطلة (-٢٥٪).

هناك صعوبة أخرى تنجم من واقع أن بعض السنوات تكون مكونة من (٥٣) أسبوعاً ولغاية التبسيط فإننا لا نعتبر إلا (٥٢) أسبوعاً، واليوم أو اليومين الإضافيين من العام سيكونان مدمجين مع الأسبوع الـ (٥٢). يأتى تصحيح أيام العمل الفعلية لتصحيح الفائض من المبيعات المرتبط بهذا الأسبوع المحتوى على أكثر من (٧) أيام. تسمح هذه الأداة الاصطناعية باعتبار المساواة بين عدد المشاهدات من سنة إلى أخرى.

يجب أن تحقق المعاملات الفصلية الأسبوعية الـ (٥٢) بعض القواعد المشتركة ( المتوسط يساوى (١) فى حال التعبير عن المعاملات بنسب مئوية، و(٠) فى حال استخدام وحدات المبيعات). كما يجب لى تكون المعاملات فعالة، أن نستخدم ثلاث سنوات أو أربع سنوات (٢٠٨ مشاهدات). وهناك صعوبة أساسية تتمثل فى عدم إمكانية المقارنة بين أسبوع (مشار إليه برقمه) مع الأسبوع نفسه من العام القادم. فهناك فى واقع الأمر بعض الاضطرابات العائدة للأعياد المتحركة أو لتقويم العطل الصيفية المدرسية مما يؤدى إلى تعديل فى المعاملات الفصلية.

#### - خوارزمية (طريقة) الحساب:

يمكن مقارنة طرائق الحساب المتبعة مع تلك المستخدمة فى حساب التنبؤات الشهرية.

فعند تطبيق طريقة داخلية ما (الصقل، كثير حدود لمركبة الاتجاه العام، بوكس وجانكينز، ...) يجب تعديل السلسلة المصححة فصلياً CVS، وكذلك تعديل التنبؤ المحسوب بواسطة السلسلة التفسيرية المكونة من معاملات تصحيحية (متماثلة لكل سلع السوق)، وهى تمثل العناصر الخارجية (ترويج المبيعات، الدعاية، ...) المشار إليها سابقاً. وهكذا فإن المعاملات الفصلية (أو بالأحرى المعاملات الفصلية المميزة) يتم تعديلها بحيث يتم دمج مجموعة هذه المتغيرات فى سلسلة إحصائية واحدة.

أما عند التطبيق لطريقة خارجية (نموذج تفسيرى) فإن ذلك يفترض معرفة المعلومات المتعلقة بالمتغيرات التفسيرية وبشكل أسبوعى. ويتم إدخال العناصر الفصلية (أعياد متحركة، عطل، ...) بواسطة متغيرات تفسيرية (متغيرات صماء) ممثلة للأعياد والعطل. فالمتغير «عيد متحرك» يأخذ القيمة (١) من أجل الأسبوع المعتبر (عيد الفصح، الميلاد، ... إلخ) والقيمة (٠) للأسابيع الأخرى، أو أيضاً المتغير «عطلة» يأخذ القيمة (١) خلال فترة العطلة المدرسية والقيمة (٠) خارج تلك الفترات.



هناك بعض المنشآت ترغب في إجراء تنبؤات للاستهلاك اليومي بغية تخطيط إنتاجها. فيمكن تقسيم التنبؤات الأسبوعية حسب الأيام وفقاً لمفتاح محسوب بواسطة المتوسطات المصقولة للقيم المشاهدة يوماً بيوم (متوسط الاثنين، متوسط الثلاثاء، ... إلخ) وذلك تبعاً لطريقة «الأوشحة». وتسمح معاملات التثقيل المحصول عليها بتقسيم التنبؤ الأسبوعي على أساس يومي.

### ٣-٢- مثال تطبيقي في مجال منتجات الجبن:

منشأة متخصصة بإنتاج وتوزيع المنتجات الطازجة للسوق الفرنسي وللتصدير ويبلغ عدد المواد حسب تصنيفها نحو (٣٥٠) منتجاً، منها نحو العشرين تشكل الأكثر أهمية من ناحية كونها مدعومة تسويقياً من قبل الموزعين وتحظى باهتمام إعلامي متلفز. وتخضع مبيعات منتجات الجبن للتغيرات في الحرارة ويكون الاستهلاك من الأجبان متديناً في حالة الحرارة المرتفعة. بالإضافة إلى ذلك، تكون المبيعات من بعض أنواع الأجبان مرتفعة في فترات الأعياد.

#### - الطريقة:

في الخطوة الأولى يجب فصل السلع العشرين المهمة التي تمثل (٨٠٪) من رقم المبيعات عن السلع العادية، ويعتبر التنبؤ بالسلع العشرين تنبؤاً إستراتيجياً، ويتم من خلال نموذج تفسيري حيث يتم اقتراح المتغيرات التفسيرية الأسبوعية التالية:

- الزيادات في التعرفة كنسبة مئوية.
  - الترويج للمبيعات لدى الموزعين: نسبة مئوية من التخفيض.
  - الترويج للمبيعات لدى المستهلكين (عروض التعويض، عينات مجانية، ...): متغير ثنائي التصنيف.
  - أنشطة تسويقية على أرض الواقع: متغير ثنائي التصنيف (١) فترة الترويج، (٠) في الحالات الأخرى.
  - حملة إعلانية متلفزة: عدد GRP<sup>(١)</sup> بالأسبوع الواحد.
  - الانحراف عن الحرارة المتوسطة.
  - الأعياد المتحركة: رمضان (متغير ثنائي، (١) لفترة العيد و(٠) فيما عدا ذلك).
  - حركة الاتجاه العام طويلة الأجل ( $t = 1, 2, 3, \dots$ ) التي تمثل التطور الطبيعي للمبيعات.
- (١) الـ GRP (Gross Rating Point) تقيس قوة الحملة الدعائية المتلفزة وتعتبر مؤشراً للحضور المحتمل. يمثل هذا المؤشر العدد الإجمالي للعروضات المحمولة لـ (١٠٠) شخص من الأشخاص المستهدفين.

أما بالنسبة للسلع العادية فإننا نستخدم تقنية الصقل الآسى مع إدخال تصحيح للعوامل الخارجية. وتكون آلية التنبؤ على النحو التالى:

- تجميع السلع حسب الفئات الفصلية.
- حساب المعاملات الفصلية لكل فئة.
- تصحيح عدد الأيام التسليم كل أسبوع.
- نزع المركبة الفصلية.
- حساب التنبؤ بواسطة الصقل الآسى أو حساب التنبؤ بواسطة نموذج تفسيرى.
- إعادة إدخال المركبة الفصلية.
- التصحيح من أجل عدد أيام التسليم.

نعرض فيما يلى النتائج لمثالين حقيقيين لمنتجين أساسيين. نسمى المنتج فى المثال الأول A (الجدول ٣) وفى المثال الثانى B (الجدول ٤). ومن أجل هاتين السلعتين تمت المقارنة بين طريقتين للتنبؤ: بواسطة الصقل (نموذج Holt) وبواسطة النموذج التفسيرى، ثم بعد ذلك تم حساب الانحرافات بين التنبؤات وبين القيم الحقيقية، وأخيراً ومن أجل المقارنة تم حساب المتوسط لكل سلسلة من الانحرافات.

النموذج التفسيرى المعتمد<sup>(١)</sup>:

$$VA_t = -94 Tendance + 6407 Paques_{t-1} + 4293 Noel_{t-1} + 2075 \Delta Tarif_{t-1} + 7 Pub_{t-1} + 25311$$

حيث:

$VA_t$ : المبيعات من المنتج A فى الأسبوع t.

$Tendance$ : التطور الطبيعى للمبيعات ( $Tendance = 1, 2, \dots, n$ ).

$Paque$ : متغير شائى التصنيف (١ لفترة عيد الفصح و٠ فيما عدا ذلك).

$Noel$ : متغير شائى التصنيف (١ لفترة الميلاد و٠ فيما عدا ذلك).

$\Delta Tarif_t$ : التغير فى التعرفة فى الأسبوع t.

$Pub_t$ : عدد ال GRP فى الأسبوع t.

(١) تم اختيار هذا النموذج بعد تطبيق طريقة انتقاء المتغيرات التفسيرية الأكثر إسهاماً فى شرح التقلبات.

الجدول رقم (٣) التنبؤ للسلعة A

الأسبوع	المبيعات الحقيقية	التنبؤ بالصقل	الانحراف	التنبؤ بالنموذج	الانحراف
٦	٢٦٥١٢	٢٧٧٩٢	١٢٨٠-	٢٨٤٧٤	١٩٦٢-
٧	٣١١٩٣	٣٠٤٢٠	٧٧٣	٣٠٣٢٤	٨٦٩
٨	٢٧٨٥٣	٣٠٦٨٠	٢٨٢٧-	٣٠٢٣٠	٢٣٧٧-
٩	٢٧٠٣٥	٢٥٦٠٦	١٤٢٩	٣٠١٣٦	٣١٠١-
١٠	٢٧٦٣٤	٢٣٢٥٣	٤٣٨١	٢٨٠٩٨	٤٦٤-
١١	٢٨٠٥٧	٢٩٤٩٠	١٤٣٣-	٢٨٠٠٤	٥٣
١٢	٢٥١٦٥	٣٥١٨٤	١٠٠١٩-	٢٧٩٠٩	٢٧٤٤-
١٣	٢٣٣٢٢	٣٠٥١٩	٢٨٠٣	٢٧٨١٥	٥٥٠٧
١٤	٣٠٤٦٣	٣٢٣١٤	١٨٥١-	٢٩٣١٢	١٢٥١
المتوسط	٢٨٥٨٢	٢٩٤٧٣	٨٩٢-	٢٨٩١١	٣٣٠-

## تعليق على نتائج التنبؤ للسلعة A:

نلاحظ أن هناك تناقصاً طفيفاً على المدى الطويل للمبيعات بمقدار (-٩٤) وحدة بالأسبوع. بالمقابل هناك تزايد بالمبيعات بمقدار (٦٤٠٧) و(٤٢٩٣) وحدة للأسبوع الذي يسبق كلاً من عيدى الفصح والميلاد (تتعلق هذه المبيعات بالبضائع المسلمة من قبل الصناعى للموزعين ومن ثم نكون بصدد توقع لحصة الموزعين). كما أن الموزعين سيتوقعون زيادة فى الأسعار من خلال فائض المخزون التضاربى قبل أسبوع (+٢٠٧٥ وحدة) وأخيراً فإن شركة الإعلان تعطى (٧) وحدات إضافية من المبيعات لكل نقطة GRP، وذلك بعد نحو أربعة أسابيع من بداية البث التلفزيونى.

فيما يخص جودة التنبؤات، فإننا نستخلص أفضلية للتنبؤات بواسطة النموذج التفسيرى من تلك التى تم الحصول عليها بواسطة عمليات الصقل الآسى (من خلال مقارنة -٢٢٠ إلى -٨٩٢).

الجدول رقم (٤) التنبؤ للسلعة B

الأسبوع	المبيعات الحقيقية	التنبؤ بالصقل	الانحراف	التنبؤ بالنموذج	الانحراف
٦	٧٦٤٥	٥٤٩١	٢١٥٤	٩٠٣٥	١٣٩٠-
٧	١٠١٠٥	٨٠٠٦	٢٠٩٩	٩٣٩٣	٧١٢
٨	٦٥٨٧	٨٥٣٢	١٩٤٥-	١٠٨٧٦	٤٢٨٩-
٩	٧٨٦٧	٧٠١٠	٨٥٧	٧٨٨٢	١٥-
١٠	٩٩٩٧	٥٦٠٧	٤٣٩٠	١٠٧١٢	٧١٥-
١١	١٢٢٨٣	٥٤٩٦	٦٧٨٧	١٠٧٦٣	١٥٢٠
١٢	٧٦٤٧	٦٢٤٥	١٤٠٢	٨٦٤٥	٩٩٨-
١٣	١٢٦٤٨	٥٨٦٦	٦٧٨٢	١٠٣٥٧	٢٢٩١
١٤	٦٨٥٤	٥٣١٢	١٥٤٢	١٠٠٠٣	٣١٤٩-
المتوسط	٩٠٧٠	٦٣٩٦	٢٦٧٤	٩٧٤١	٦٧٠-

$$VB_i = 34 Tendance - 478 \Delta Tarif_i - 320 Temperature_{i-4} + 6429$$

حيث:

$VB_i$ : تمثل المبيعات من المنتج B عند الأسبوع  $i$ .

$Tendance$ : التطور الطبيعي للمبيعات (مركبة الاتجاه العام،  $Tendance = 1, 2, \dots, n$ ).

$\Delta Tarif_i$ : التغيير في التعرفة في الأسبوع  $i$ .

$Temperature'$ : الانحراف عن درجة الحرارة المتوسطة (قراءة الثلاثين) للأسبوع  $i$ .

تعليق على نتائج التنبؤ للسلعة B:

هناك اتجاه عام للزيادة في المبيعات بمعدل (٢٤) وحدة أسبوعياً ويتضح وجود تأثير انكماشى واحد في المبيعات بمقدار (-٤٧٨) وحدة مرتبطاً بارتفاع الأسعار. وذلك خلال فترة أسبوع الارتفاع نفسه. وأخيراً يلاحظ انخفاض في المبيعات بمقدار (٢٢٠) وحدة لكل درجة حرارة أعلى من الحد المعيارى الفصلى، وذلك يحصل بعد أربعة أسابيع من الزيادة غير الطبيعية في درجات الحرارة، وهذه الفترة (٤ أسابيع)

تمثل فترة رد الفعل بين الانخفاض فى الاستهلاك الملاحظ من مخرجات الصندوق وبين انعكاس ذلك على الصناعى.

فيما يخص جودة التنبؤات، فإننا نستخلص أيضاً أفضلية للتنبؤات بواسطة النموذج التفسيري من تلك التى تم الحصول عليها بواسطة عمليات الصقل الآسى وبمعدل أربع مرات أكثر دقة (من خلال مقارنة - ٦٧٠ إلى ٢٦٧٤).

تتميز هذه الطريقة فى المعالجة للحالة المدروسة بالخصائص التالية:

- يتم التنبؤ بشكل أسبوعى وهذا يتوافق مع طبيعة المنتجات الطازجة حيث تستلزم هذه المنتجات عمليات إعادة توريد متكررة، وتكون استحقاقات شركات الإعلان والدعاية بشكل أسبوعى.
- يمكننا من خلالها استخدام خوارزميتين مختلفتين لإجراء التنبؤ.
- تمكنا من الأخذ بعين الاعتبار للتنوع فى أنماط الترويج للمبيعات، من خلال إدخال ما نريد من المتغيرات التفسيرية ثنائية التصنيف حيث يشير المعامل لمتغير ما إلى الأثر الكمى لكل نمط من أنماط ترويج المبيعات.

#### ٤- حساب المرونات والتنبؤ بتأثير الإجراءات التسويقية:

##### ١-٤- عرض طريقة التقدير:

يسمح معامل المرونة بقياس التزايد لمتغير ما (المبيعات) الناتج عن التغيرات فى متغير آخر (السعر، الترويج، الدعاية، عدد التجار، ... إلخ). والفائدة من ذلك واضحة تتلخص فى أن معامل المرونة يسمح للقائم على التنبؤ بفهم تأثير تغير متغير تسويقي ما فى المبيعات. فعادة ما يطرح السؤال التالى: إذا ازدادت الميزانية المخصصة للإعلان بمقدار (١٢٪) فكم سوف تزداد المبيعات؟ أو إذا ازداد عدد الزائرين المرضى من (٨٥) إلى (٩٥)، فكم ستكون الزيادة فى عدد الوصفات الطبية؟ تسمح الإجابة عن هذه الأسئلة بتقييم مردودية الاستثمار فى مجالات محددة.

لحساب معامل مرونة المبيعات بالنسبة للسعر نستخدم العلاقة التالية:

$$e = \frac{dV / V}{dP / P} = \frac{dLogV}{dLogP}$$

حيث تمثل  $V$  المبيعات و  $P$  السعر.

ليس لمعامل المرونة وحدة قياس ويتم تفسيره بشكل بسيط. فعلى سبيل المثال إذا كانت القيمة المقدرة لمعامل المرونة تساوى  $(-0.85)$ ، فهذا يعنى أنه إذا ازداد السعر بمقدار  $(5\%)$  فإن المبيعات ستتخف بمقدار  $-4.25 = -0.85 \times 5$  أى  $(4.25\%)$ .

تستند طريقة التقدير إلى نماذج الانحدار البسيطة والمتعددة ومن ثم يمكن استخدام البرنامج إكسل لإجرائها بسهولة. ويتم تحويل المتغيرات بشكل مسبق من خلال أخذ اللوغاريتم لها، وبما أن معامل المرونة يمثل النسبة للمشتقات اللوغاريتمية فإن معامل الانحدار يُفسر مباشرة على أنه معامل المرونة.

على سبيل المثال، يتم تقدير مرونة المبيعات بالنسبة للسعر من خلال النموذج التالى:

$$\text{Log } V_t = a_0 + a_1 \text{LogPRIX}_t$$

حيث يمثل المعامل  $a_1$  المقدّر معامل المرونة  $e$ .

الغاية من النموذج اللوغاريتمى هى تقديم مرونة ثابتة سهلة الحساب رغم عدم أحقية هذا الافتراض أحياناً.

يمثل الجدول رقم (٥) أشكال المرونة التى يمكن أن نواجهها والأكثر استخداماً.

الجدول رقم (٥) أشكال المرونة

نمط المرونة	المتغير التفسيري	المتغير الواجب تفسيره
المرونة السعرية المباشرة	السعر	المبيعات
المرونة الإعلانية المباشرة	الدعاية	المبيعات
مرونة السعر المتقاطع	السعر المنافس	المبيعات
مرونة الإعلان المتقاطع	الإعلان المنافس	المبيعات
المرونة السعرية المباشرة	مؤشر الأسعار	حصة السوق
المرونة السعرية المتقاطعة	مؤشر الأسعار المنافس	حصة السوق
المرونة الإعلانية المباشرة	حصة الإعلان	حصة السوق
مرونة الإعلان المتقاطع	حصة الإعلان المنافسة	حصة السوق

نعرض هنا بعض الأمثلة عن النماذج الواجب تقديرها وكيفية تفسير المعاملات:

$$\text{Log } V_i = a_0 + a_1 \text{Log } \text{PRIX}_i + a_2 \text{Log } \text{PRIXCONCURRENT}_i$$

حيث:  $V_i$  تمثل المبيعات و  $\text{PRIX}_i$  سعر البيع و  $\text{PRIXCONCURRENT}_i$  سعر البيع المنافس.

كما أن  $a_1$  تمثل مرونة المبيعات بالسعر المباشر و  $a_2$  مرونة المبيعات بالسعر المتقاطع (مع المنافسين).

$$\text{Log } PM_i = a_0 + a_1 \text{Log } \text{IPRIX}_i + a_2 \text{Log } \text{IPRIXCONCURRENT}_i$$

حيث  $PM_i$  تمثل حصة السوق،  $\text{IPRIX}_i$  مؤشر سعر المنتج، و  $\text{IPRIXCONCURRENT}_i$  مؤشر أسعار المنتجات المنافسة.

وتكون  $a_1$  مرونة حصة السوق بالسعر المباشر، و  $a_2$  مرونة حصة السوق للسعر بالسعر المتقاطع.

$$\text{Log } PM_i + a_0 + a_1 \text{Log } \text{IPX}_i + a_2 \text{Log } \text{IPC}_i + a_3 \text{Log } \text{PUB}_i + a_4 \text{Log } \text{PUBC}_i$$

حيث  $PM_i$  تمثل حصة السوق، و  $\text{IPX}_i$  مؤشر سعر المنتج، و  $\text{IPC}_i$  مؤشر أسعار المنتجات المنافسة، و  $\text{PUB}_i$  النفقات الإعلانية للمنشأة و  $\text{PUBC}_i$  النفقات الإعلانية المنافسة.

وتكون  $a_1$  مرونة حصة السوق بالسعر المباشر، و  $a_2$  مرونة حصة السوق للسعر بالسعر المتقاطع و  $a_3$  مرونة حصة السوق للنفقات الإعلانية المباشرة و  $a_4$  مرونة حصة السوق للنفقات الإعلانية للمنافسين.

#### ٤-٢- أمثلة حسابية:

يبحث مدير تسويق منشأة تعمل في قطاع منتجات الصيانة عن العلاقة بين مبيعات تلك المنشأة ونفقاتها الإعلانية ولديه من أجل ذلك معطيات تتعلق بالمبيعات وبالنفقات الإعلانية للأعوام الممتدة من عام ١٩٩١ إلى ١٩٩٥ وبشكل فصلى (الجدول ٦).

الجدول رقم (٦) المبيعات والنفقات الإعلانية (الملف C7 EX4.XKS)

العام	الفصل	المبيعات	النفقات الإعلانية بالآلاف الفرنكات
١٩٩١	T١	١٦٤	٣٤
	T٢	١٩٨	٢٦
	T٣	٨٥	٣٢
	T٤	١٧٩	٢٩
١٩٩٢	T١	١٦٨	٤٥
	T٢	٢٠١	٦٧
	T٣	٩٨	٧٦
	T٤	١٩٧	٧٥
١٩٩٣	T١	١٩٧	٧٥
	T٢	٢٠٩	٧٨
	T٣	١٠٠	٧٢
	T٤	٢١٦	٧٥
١٩٩٤	T١	٢٢٣	٧٨
	T٢	٢٤٥	٨١
	T٣	١١٩	٨٤
	T٤	٢٦٠	٨٣
١٩٩٥	T١	٢٩٨	٨٩
	T٢	٣٠٩	٨٢
	T٣	١٢٤	٨١
	T٤	٢٦٧	٨٣

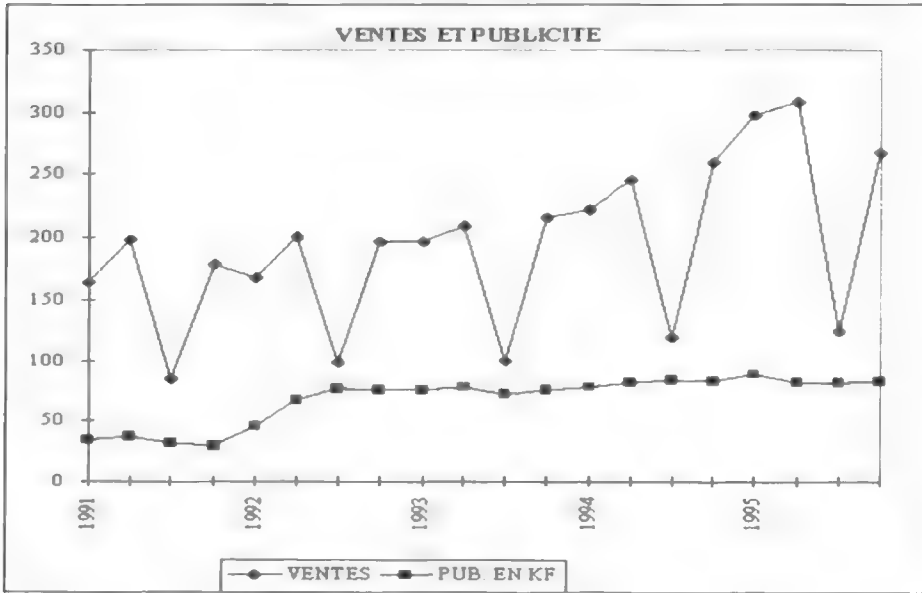
وبحساب معامل الارتباط الخطى بين المبيعات والإعلان نجد  $\rho_{\text{ventes.pub}}^2 = 0.16$  وقيمة اختبار ستيودنت التجريبي (الفصل الرابع) يساوي  $t = 0.85$  وبالمقارنة مع القيمة الجدولية عند مستوى دلالة (٥٪) و(١٨) درجة حرية والمساوية (٢, ١٠)



نستخلص أن  $1.85 < 2.10$ ، ومن ثم فإن معامل الارتباط المحسوب لا يعتبر مختلفاً معنوياً عن القيمة صفر، ومن ثم غير جوهري، أى لا يوجد، على ما يبدو، علاقة بين المبيعات والإعلان.

ولكن النظر إلى التمثيل البياني للمبيعات وللنفقات الإعلانية (الشكل البياني رقم ٤) يوحي بوجود مركبة فصلية واضحة فى سلسلة المبيعات وعدم وجودها فى النفقات الإعلانية. لهذا السبب فإن معامل الارتباط الذى سبق أن حسبناه كان ضعيفاً. ففى واقع الأمر، التحليل بخصوص الارتباط لا يمكن إجراؤه بين سلسلتين إلا إذا كانت هاتان السلسلتان غير فصليتين أى CVS.

الشكل البياني رقم (٤) المبيعات والإعلان



الآن عند إعادة حساب معامل الارتباط بين سلسلة المبيعات المخلصة من التأثير الفصلى أى CVS (الجدول ٧) وبين النفقات الإعلانية يظهر لنا مساوياً لـ  $\rho^2_{ventesCVS,pub} = 0.57$  وتصبح القيمة التجريبية لاختبار ستيودنت  $t = 4.93$  وهى أكبر من القيمة الجدولية المساوية (٢٠، ١٠)، ومن ثم فإن معامل الارتباط أصبح الآن مختلفاً معنوياً عن القيمة صفر. ونستطيع الآن حساب معامل مرونة المبيعات للنفقات الإعلانية.

التقدير الاقتصادي القياسى يقود إلى النتائج التالية:

$$LOG VENTES CVSt = 0.36 LOG PUB_t + 1.61$$

(4.74)

$$R^2 = 0.55, \quad n = 20, \quad (.) t \text{ de Student}$$

نلاحظ أن معامل المرونة  $\hat{a}_1 = 0.36$  مختلف معنوياً عن القيمة صفر

( $t^* = 4.74 > t = 2.10$ ). فإذا ازدادت النفقات الإعلانية بمقدار (١٠٪) فإن

المبيعات ستزداد بمقدار (٢.٦٪). ولمعرفة ما إذا كانت المنشأة تحقق مردودية من استثمارها الإعلاني، يكفى مقارنة تكلفة الزيادة في الميزانية الإعلانية بالربح المتحقق المرتبط بالزيادة (المتوقعة) للمبيعات.

الجدول رقم (٧) المبيعات CVS ولوغاريتم المبيعات CVS والنفقات الإعلانية

العام	الفصل	المبيعات CVS	لوغاريتم المبيعات CVS	لوغاريتم الإعلان
١٩٩١	T١	١٣٩	٢.١٤	١.٥٣
	T٢	١٥٧	٢.٢٠	١.٥٦
	T٣	١٤٨	٢.١٧	١.٥١
	T٤	١٥٣	٢.١٨	١.٤٦
١٩٩٢	T١	١٤٣	٢.١٥	١.٦٥
	T٢	١٥٩	٢.٢٠	١.٨٣
	T٣	١٧٠	٢.٢٣	١.٨٨
	T٤	١٦٨	٢.٢٣	١.٨٨
١٩٩٣	T١	١٦٧	٢.٢٢	١.٨٨
	T٢	١٦٦	٢.٢٢	١.٨٩
	T٣	١٧٤	٢.٢٤	١.٨٦
	T٤	١٨٤	٢.٢٧	١.٨٨
١٩٩٤	T١	١٩٠	٢.٢٨	١.٨٩
	T٢	١٩٤	٢.٢٩	١.٩١
	T٣	٢٠٧	٢.٣٢	١.٩٢
	T٤	٢٢٢	٢.٣٥	١.٩٢
١٩٩٥	T١	٢٥٣	٢.٤٠	١.٩٥
	T٢	١٤٥	٢.٣٩	١.٩١
	T٣	٢١٦	٢.٣٣	١.٩١
	T٤	٢٢٨	٢.٣٦	١.٩٢

## ٤-٣- قياس المرونة السعرية وتقييم تأثير الدعاية:

نستطيع من خلال المعطيات الضوئية Scanners (الفصل الثامن) إجراء تحليل دقيق للحساسية تجاه الأسعار، وبشكل خاص في حالة الطلب الانتقائي، أى الطلب المتعلق بمنتهج ما أو بماركة ما محددة. ومن خلال التحليل للدراسات حول المرونة السعرية للطلب الانتقائي نذكر دراسة (Tellis ١٩٨٨ b, p ٣٢٧) التى أظهرت أن المرونة السعرية هى أكبر بثمانى مرات بالمتوسط من المرونة الإعلانية المساوية (٠.٢٢) التى تم الحصول عليها من دراسة (Assmus et al. ١٩٨٤). هناك دراسات أخرى أيضاً تم من خلالها إجراء تحليل لتأثير خصائص العلامة (الماركة) وسياسات بائعى المرفق على استجابة المستهلكين من خلال مفهوم المرونة السعرية (Karande et Kumar, ١٩٨٥, Shankar eth Krishnamurthi, ١٩٩٦)، ولقد تبين أيضاً أن الخصائص الاجتماعية السكانية أكثر أهمية من المتغيرات المرتبطة بالمنافسة فى شرح حساسية المستهلكين تجاه الأسعار (Hoch et al, ١٩٩٥).

نستطيع من خلال التنبؤ أيضاً وباستخدام قواعد المعطيات الضوئية قياس التأثير النسبى للأسعار وللإعلان فى حركة المبيعات، ومن ثم يمكننا التمدد الخارجى واتخاذ القرار حول الإجراء المناسب إما بتخفيض الأسعار وإما الاستثمار من جديد فى مجال الإعلان. لقد أجرى (Tellis al, ١٩٨٨) دراسة تستند إلى المعطيات الضوئية واستخدام نموذج Logit، وقد ركز من خلالها على العلاقات بين الإعلان وإخلاص المستهلك وبين الخيارات التى يبدىها هذا الأخير لماركة محددة دون غيرها. السؤال الذى تم اختياره هو تقييم تأثير العرض المتكرر للنصوص الإعلانية على المستهلكين. ومن خلال نتائج الدراسة تبين أن الإعلان يكون فعالاً فى زيادة حجم المشتريات للزبائن المخلصين ولكنه أقل فعالية فى كسب زبائن جدد. ووفقاً للدراسة نفسها فإن الأخذ بعين الاعتبار لفعالية بعض المتغيرات التسويقية الأخرى وخصوصاً متغير تغيير الماركة قد أدى إلى ظهور إستراتيجية معقولة تقضى بتشجيع محاولات الشراء عبر استخدام العينات المجانية والكوبونات، وبعد ذلك دعم عمليات إعادة الشراء بواسطة الإعلان ....

## ٤-٤- نماذج عن فعالية الإجراءات الترويجية:

قام Gupta عام ١٩٨٨ بتحليل أثر الترويج للمبيعات فى ثلاثة قرارات للمستهلك، وهى: متى وماذا وكى يشتري؟ ومن أجل ذلك استخدم ثلاثة نماذج، واحداً لتمثيل القرارات الزمنية للشراء (Erlang - ٢ interpurchase time model)، وآخر نموذج

Logit (كثير حدود متعدد) لاختيار الماركة، والثالث Logit (تجميعي) لتحديد الكميات المشتراة. ومن خلال النتائج يتضح مرة أخرى الدور الأساس لعملية الترويج للمبيعات التي تؤدي إلى تغيير الماركة. هناك (٨٤٪) من الزيادة في المبيعات المرتبطة بالترويج تعود إلى تغييرات الماركة، في حين أن تزايد المبيعات مع الزمن (الشراء المتوقع) لا يمثل إلا (١٤٪) من المبيعات الإضافية. وهناك (٢٪) فقط تعود إلى اقتناء المخزون من قبل المستهلك جراء بعض العروض التشجيعية.

هناك مجموعة من النماذج المستخدمة للتنبؤ بفعالية الإجراءات الترويجية (١٩٩٤ Volle, Reibstein et Traver ونموذج (١٩٩٠) Neslin. ومنها من نمط «الموزع» مثل نموذج PROMOTER ((Abraham et Lodish (١٩٨٧). تعتمد النماذج من نمط المستهلك على الترويج من خلال توزيع الكوبونات والغاية من ذلك هي تقدير المبيعات الإضافية العائدة لهذه العملية وبحيث تكون الفعالية مرتبطة بحصول الزبون على تخفيضات بمجرد إبرازه للكوبون. وقد قام (١٩٨٢) Reibstein et Traver بتقدير نموذج نسبة التخفيض باستخدام الانحدار المتعدد على مجموعة من المتغيرات التفسيرية الممكنة ابتداء بالقيمة الوجهية للكوبون وبنسبة التخفيض على سعر المنتج حتى عدد الكوبونات الموزعة، مروراً بالأنماط المختلفة للدعم المادي للكوبون وللمنتج نفسه. تسمح المعاملات المقدرة للنموذج على مجموعة من المعطيات المقطعية لـ (١٤٠) عملية ترويجية، بالتنبؤ بتأثيرات الترويج معبراً عنها بمعدل التخفيض وإنطلاقاً من الخصائص المميزة لعملية إصدار الكوبون. هناك طريقة أخرى تقضى أولاً بإيجاد النموذج لتخفيض الكوبونات، ومن ثم قياس تأثيرها في المبيعات. لقد قام (١٩٩٠) Neslin باستخدام سبعة أصناف من القهوة وقدر نسبة المبيعات المتزايدة العائدة إلى الكوبونات التي تتعلق بكون البيع يتم للمستهلكين غير المخلصين للماركة، وكانت هذه النسبة تتراوح من (٠,٢١) إلى (٠,٥٤).

يستخدم نموذج PROMOTER ((Abraham et Lodish (١٩٨٧) أساساً لنموذج PROMOTIONS SCAN, d'IRI-Secodip ويتعلق بالتنبؤ بتأثير الترويج للمبيعات من النمط «الموزع». ومن خلاله يتم تقسيم المبيعات المشاهدة إلى مبيعات أساسية ومبيعات إضافية، وهذه الأخيرة تعود إلى الترويج للمبيعات من النمط «الموزع». يشتمل هذا النموذج على عدة مراحل (١٩٩٤) Volle, مرحلة تحليل السلاسل الزمنية للمبيعات الأسبوعية التي تسمح بعزل مكونات حركة الاتجاه العام والفصلية للحوادث الاستثنائية ومن ثم مرحلة حساب خط الأساس baseline أي السلسلة الزمنية لمستوى

المبيعات التي كان يمكن أن تكون دون إجراء الترويج للمبيعات. ويتم إنشاء هذه السلسلة من خلال تخليص السلسلة من مجموعة الفترات الزمنية حيث يوجد تأثيرات ترويجية والاكتفاء بالمعطيات الناتجة. بعد ذلك يتم، في المرحلة الأخيرة، إجراء عملية تمديد خارجي للمعطيات الأخيرة، ومن ثم نستطيع حساب تأثير الترويج للمبيعات من خلال الفروقات بين المبيعات المشاهدة خلال فترة الترويج والمبيعات لخط الأساس .baseline

## الفصل الثامن

### المنتجات ذات الاستهلاك الكبير (٢)

#### التنبؤ باستخدام المعطيات الضوئية Scanner

تم منذ عدة سنوات استخدام التقنية الضوئية لقراءة أسعار المنتجات في المجمعات التجارية الكبرى، وتعتمد هذه الطريقة على قراءة مجموعة من الخطوط المرمزة بشكل آلي وتسمح بالحصول على المبيعات بشكل فوري ودقيق، ومن ثم تشكيل سلاسل زمنية من المبيعات على مستوى المستهلك الفردي، وليس كما كان الوضع في الحالات السابقة أى على المستوى التجميعي للمستهلكين. ونستطيع من خلال هذه التقنية ملاحظة السلوك التفصيلي للشراء لعينة من المستهلكين الذين قبلوا أن يشكلوا مجموعة مراقبة لدراسة أوضاع السوق Panels. وعبر هذه التقنية تم استخدام النماذج ذات الخيار الثنائي (شراء/عدم شراء) كأداة لتحليل المعطيات المجمعة والتي تفسر سلوك المستهلك عبر مجموعة من المتغيرات الأساسية المتعلقة بالسياسة التسويقية (نوع المنتج، السعر، الترويج والتخفيضات، والبيانات الديموغرافية والاجتماعية، والبيانات السلوكية، ... إلخ).

نعرض في القسم الأول من هذا الفصل مصادر المعطيات، أى مجموعات عينات الاختبار Panels وقواعد البيانات الناتجة عنها والمستخلصة من القراءة الضوئية في المجمعات التجارية، وكذلك نعرض النموذج المناسب لاستثمار هذه البيانات وهو النموذج Logit. ثم نعرض في القسم الثاني طرائق التنبؤ بالمبيعات للمنتجات الجديدة وطرائق قياس الفعالية الإعلانية باستخدام المعطيات ذات المصدر الواحد "Single-source" التي تشمل معطيات الاستهلاك (المستندة إلى مجموعات الاختبار Panels للمستهلكين وللموزعين) ومعطيات الإصغاء audience (المستندة على مراقبة لعينات الاستهلاك من الأسر عبر وسائل مختلفة). في القسم الثالث نبين كيف يمكن لتخمينات السوق التجريبي أن تكون مستخدمة من أجل التنبؤ السنوي على أساس المعطيات الضوئية، ويكون القسم الأخير مخصصاً لعرض تطبيق تقنيات "data mining" في التنبؤ المتعلق بإخلاص الزبون.

## ١- إيجاد النموذج لخيارات المستهلكين:

## ١-١- مجموعات الاختبار Panels والمعطيات الضوئية:

تمثل مجموعات الـ Panels عينات استطلاعية منتظمة ودائمة من الأسر أو من الوحدات بالمعنى الإحصائي (محل تجارى على سبيل المثال) حيث يتم سؤال هذه المجموعات عن سلوكيات الشراء أو آرائهم بشكل منتظم. وهذه المجموعات نوعان، واحدة خاصة بالمستهلكين والأخرى بالموزعين. ومثالاً على مجموعات استطلاع الرأى للمستهلكين، نذكر شركة IRI-Secodip التى تمتلك مجموعتين مكونتين من (٥٠٠٠) أسرة، واحدة للسلع الاستهلاكية الجارية والأخرى مكونة من مجموعة من النساء من العمر (١٥) فما فوق، تركز على المشتريات من منتجات الحمام والنظافة والعطور. وتقوم عناصر هاتين المجموعتين بإرسال كشف مشترياتهم مرة واحدة كل أسبوع متضمناً النوع والكمية والسعر بواسطة البريد إلى الشركة Secodip. أما فيما يخص مجموعات استطلاع الرأى للموزعين فنشير هنا إلى مجموعات Nilsen (IRI-Secodip) وINTERCOR وGfk-France، وهذه المجموعات تستند إلى عينة دائمة من نقاط البيع بالفرق. ويقوم موظفو شركة Nielsen بالمرور مرة واحدة كل شهرين لأخذ كشف كامل للمشتريات للفترة المدروسة وحساب المخزون. المؤشران الأساسيان المعتمدان هنا هما مؤشر الـ DN (Distribution Numérique): النسبة المئوية للمحلات التجارية المتعاملة بماركة محددة) ومؤشر الـ DV (Distribution Valeur): حصة الماركة/ رقم الأعمال الإجمالى لفئة المنتجات).

خلال الثمانينيات من القرن الماضى تم تطوير أنظمة آلية تسمح باستخدام القارئ الضوئى لمعالجة صناديق محاسبة المبيعات وتسمى هذه الأنظمة "Scanning". وتستند إلى قراءة رمز لمجموعة من الخطوط (يسمى فى فرنسا GENCOD). وهذا النظام معيارى على المستوى الدولى (المعيار EAN). ويسمح هذا الرمز بالتعريف بالمنتج وببلد التصنيع وبالمصنع، وهو يبسط مجموعة الإجراءات الإدارية بين الموردين والموزعين.

ومن أجل الأخذ بعين الاعتبار للتخفيضات المخصصة للمستهلك النهائى (هدية، بطاقة تخفيض، ...) فقد تم استخدام رمز متغير (VA) ذى رقمين وموزع من قبل المنتج ويكمل التعريف بالمنتج. لقد كان لدى العديد من مؤسسات استطلاع الرأى ومؤسسات البحث التسويقى التجارى فكرة استخدام مجموعة المعلومات من أجل إنشاء أدوات آلية للبحث التسويقى وذلك فى إطار التقييم والتنبؤ:

- تقييم النجاح لمنتج جديد .
- تقييم التأثير المحتمل لنوع ما من أنواع الترويج التسويقي للمبيعات .
- قياس بعض الإجراءات المرتبطة بسلوكية المستهلك (إعادة الشراء، وفاء المستهلك وإخلاصه لماركة معينة ...).
- إجراء تنبؤات للمبيعات لمجال زمني قصير (بضعة أسابيع).

من أجل ذلك، يجب جمع المعطيات بشكل نظامي لعدة محلات تجارية ولعدة مستهلكين. ولكن هناك خشية حول مدى تمثيل البيانات تتلخص بما يلي:

- يتوجب على المستهلكين إجراء مشترياتهم الأساسية من بضعة محلات، وهذه الأخيرة يجب أن تكون مغطاة بنظام جمع المعطيات. وهذا الإجراء يفرض نفسه لكى تكون المعطيات ممثلة بشكل جيد لإجمالى سلوكية الشراء لكل واحد من هؤلاء المستهلكين.
- يتوجب على مجموعة المحلات التجارية التى يتم فيها جمع البيانات أن تكون ممثلة بشكل جيد للمجتمع الأم (المستهلكون لمنطقة ما أو حتى للبلد بأكمله).

يضاف إلى ذلك أن المستهلكين الذين وافقوا على اعتبارهم جزءاً من عينات الاختبار أو الرأى مقابل بعض المنافع المادية خلال تسديد مشترياتهم سيسمحون بوجود علاقة بين مشترياتهم وبين صفاتهم الخاصة (العمر، الجنس، الوضع العائلى، الدخل، ... إلخ). وبشكل عام ستزداد كمية البيانات المجموعة، وكذلك دقتها عند اعتبار الفترة الأسبوعية للشراء وعند وضوح دليل المنتج (الشكل، النوع بدقة، التخفيضات والصفات الخاصة المؤقتة المرتبطة بالمنتج).

حالياً هناك العديد من مؤسسات مجموعات الرأى Panels التى تتعامل مع قواعد البيانات ذات الجودة المحسنة من حيث شمولها للمجمعات التجارية الكبرى. فهناك على سبيل المثال المؤسسة الأميركية (IRI (Information Resources Inc. التى تعرض بيانات تغطى إجمالى الأسواق الأساسية فى الولايات المتحدة. كذلك هناك مؤسسة A.C. Nielsen الأولى عالمياً فى مجال شركات الرأى، وتستخدم النظام SCAN-TRACK الذى يجمع فى فرنسا المعطيات حول المشتريات لبضعة آلاف من المحلات التجارية المتوزعة فى عشرة مناطق جغرافية. بمقابل مؤسسة A.C. Nielsen تقترح مؤسسة IRI-Secodip نظاماً يغطى مدينة (Chateau-Thierry (INFOSCAN. تسمح هذه الفكرة بتمثيل أفضل لمشتريات المستهلكين عبر المعطيات الضوئية، ولكنها لا تغطى إجمالى السوق الوطنى حتى لو كانت المدينة



المختارة ممثلة لإجمالي الأرض الفرنسية. أيضاً هناك مؤسسة Marketing Scan فرع Gfk و Mediametrie-rxpansion التي تقترح النظام BEHAVIORSCAN المستند إلى سوقين اختباريين دائمين في غرب فرنسا هما، سوق مدينة Angers وسوق مدينة Le Mans، وهما يشكلان تجمعا يقدر بـ (١٥٠٠٠٠) ساكن، وهناك مجموعة اختبارية panel للمستهلكين مكونة من مجموعة من الأسر ومجموعة اختبارية للموزعين مكونة من مجموعة من المحلات التجارية والسوبر ماركت، التي تمثل (٩٥٪) من مبيعات المشرق المحقة في هذه المناطق. وقد تم اختيار هذين الموقعين الجغرافيين لأن لهما بنية سكانية اجتماعية قريبة من تلك الخاصة بالمتوسط الوطنى، وكذلك لمتنع سكان تلك المدن بخاصية إجراء مشترياتهم أو معظمها من المحلات المغطاة بنظام جمع البيانات.

يبين الجدول (١) مكونات هذين السوقين الاختباريين ولقد تم تخصيص غرفة إصغاء صوتى لنصف الأسر في مدينة Angers تسمح بمعرفة المحطات المشاهدة من قبل أفراد الأسرة، ومن ثم قياس مدى رؤيتهم للإعلانات السابقة بطريقة تجريبية.

الجدول رقم (١) مكونات العينات الاختبارية panel فى نظام BEHAVIORSCAN

النظام BEHAVIORSCAN	مجموعة المستهلكين	مجموعة الموزعين
موقع Angers	٤٠٠٠ أسرة مزودة ببطاقة تعريف رقمية و ٢٠٠٠ منها مجهزة بغرفة إصغاء.	٧ محلات تجارية ضخمة تشكل ٤١٢٠٠ متر مربع من مساحة المبيعات وتمثل ٩٥٪ من مبيعات المنطقة.
موقع Le Mans	٢٠٠٠ أسرة مزودة ببطاقة تعريف رقمية.	٩ محلات تجارية ضخمة تشكل ٥١٢٠٠ متر مربع من مساحة المبيعات وتمثل ٩٥٪ من مبيعات المنطقة.

تعتبر قواعد البيانات الضوئية ذات أهمية كبيرة للتسويق الكمي وللتنبؤ بالمبيعات. فبواسطتها لم نعد نمثل ظواهر المبيعات بشكل تجميعى وعلى فترات زمنية طويلة، شهر على الأقل، كما لم نعد نمثلها على مجموعة كبيرة جداً من المستهلكين. من هذا

الواقع نستطيع الاقتراب شيئاً فشيئاً من إجراء التنبؤ على معطيات حقيقية ودقيقة (بشكل أسبوعي عموماً)، وذلك من خلال اختبار تأثير إجراءات محددة جداً على المنتجات وعلى مجموعات المستهلكين المحددة بدقة. يبقى إذن بعد جمع البيانات والتأكد من مدى تمثيلها، إيجاد النموذج الرياضى الذى يسمح باستثمار هذه البيانات وهذا ما سنراه من خلال النموذج المسمى بنموذج Logit.

### ١-٢- مجموعة نماذج Logit:

المبدأ الأساسى لهذه النماذج يعتمد على البحث عن النموذج لمتغير ثنائى التصنيف يأخذ القيمة (٠) عندما لا يشتري المستهلك المنتج فى الفترة  $t$  والقيمة (١) عندما يشتريه.

ومن خلال هذه النماذج نستطيع الانتقال من تفسير المتغير الثنائى الفردى إلى تفسير احتمالية الشراء على مستوى مجموعة المستهلكين. لهذه المجموعة من النماذج العلاقة الرياضية التالية:

$$P_i = F(Z_i) = \frac{1}{1 + e^{-Z_i}} = \frac{1}{1 + e^{-(\alpha + \beta X_i)}}$$

حيث:

$P_i$ : تمثل احتمال إجراء المستهلك  $i$  لخيار ما محدد.

$X_i$ : خاصية من خصائص الفرد  $i$  (دخله على سبيل المثال).

$e$ : أساس اللوغاريتم النيبيرى.

$\alpha$ : الحد الثابت و  $\beta$  تقيس تأثير الخاصية على القانون الاحتمالى.

يستخدم هذا النموذج متغيراً تفسيرياً واحداً ويمكن تعميمه ليشمل مجموعة من المتغيرات التفسيرية عددها  $k$  متغيراً تفسيرياً تمثل خصائص أخرى للفرد (العمر، الجنس، ... إلخ).

- صعوبات التقدير الإحصائى واللجوء إلى نموذج Logit:

فى نموذج الانحدار الخطى العادى يكون المتغير الواجب تفسيره متغيراً مستمراً، ومن ثم يمكن أن يأخذ كل القيم الحقيقية ولكن فى حال رغبتنا فى اعتبار متغير يأخذ فقط قيمتين اثنتين، فإن نموذج الانحدار العادى لم يعد صالحاً. بالإضافة إلى ذلك،

فإن الشروط الاعتيادية لتقدير النموذج لم تعد محققة، ومن ثم ستكون المعاملات المقدرة غير معنوية إحصائياً<sup>(١)</sup>.

- نموذج Logit متعدد الحدود:

يستند هذا النموذج إلى بعض المسلمات الرياضية الأساسية<sup>(٢)</sup>. لنأخذ الفرد  $i$  الذي يواجه اختياراً بين مجموعة من بدائل الحلول  $S_i$  (أى الخيار بين عدة أنواع (ماركات) أو عدة أشكال)، نفترض أن:

(١) - يقدم الحل البديل  $k$  بالنسبة للفرد  $i$  منفعة  $u_k$

$$u_k = v_k + \varepsilon_k$$

حيث:

$v_k$ : هى المركبة الجبرية لمنفعة الفرد  $i$  والتي نحسبها انطلاقاً من القيم المشاهدة للمتغيرات التفسيرية.

$\varepsilon_k$ : هى مركبة عشوائية لمنفعة الفرد  $i$ ، متغيرة من فرصة خيار إلى أخرى (من شراء إلى آخر) ومرتبطة بمجموعة المتغيرات التي لا يمكننا ملاحظتها، ومن ثم أخذها بعين الاعتبار.

(٢) - مقابل مجموعة البدائل السابقة، فإن الفرد  $i$  يختار البديل الذى يوفر له المنفعة الأكبر. بمعنى آخر فإن احتمال اختيار البديل  $k$  (شراء المنتج  $k$  دون غيره) هو:

$$P_k = P(u_k \geq u_j, j \in S_i)$$

(٣) - تخضع  $\varepsilon_k$  لتوزيعات عشوائية مستقلة من النوع الآسى المضاعف.

انطلاقاً من الفرضيات السابقة، يمكننا البرهان<sup>(٣)</sup> على أن احتمال الخيار لمنتج ما / البديل  $k$  من قبل الفرد  $i$  له الشكل التالى:

$$P_k = \frac{e^{v_k}}{\sum_{j \in S_i} e^{v_j}}$$

(١) لم تعد مصفوفة التباين والتباين المشترك للأخطاء تحقق فرضياتها، أى القيم الصفرية خارج القطر الأول والقيم الثابتة على هذا القطر.

(٢) Guadagni et Little (١٩٨٣)

(٣) Theil (١٩٦٩)

وهذا يمثل موديل Logit متعدد الحدود.

يمكن التعبير عن المركبة الجبرية لمنفعة المستهلك (العضو في مجموعة الاختبار) من المنتج البديل  $k$  كتابع خطى للمتغيرات المشاهدة الممثلة لخصائص المنتج  $k$ . إذ إن جزءاً من هذه الخصائص سيكون من مواصفات المنتج (السعر على سبيل المثال) والجزء الآخر من خصائص المستهلك أو بيئته (الدخل أو نوع ومساحة المحل، المعطيات المناخية، ... إلخ). تمثل هذه المركبة بيانات أولية للإدخال على المعادلة السابقة ويعبر عنها بالطريقة التالية:

$$v_k^i = \sum_{j \in T} b_{jk} x_{jk}^i$$

حيث:

$x_{jk}^i$ : تمثل القيمة المشاهدة للخاصة  $z$  للمنتج البديل  $k$  بالنسبة للمستهلك  $i$ .  
 $b_{jk}$ : تمثل التثقيل للخاصة  $z$  للمنتج البديل  $k$ .

## ٢- التنبؤ بالمبيعات للمنتجات الجديدة وقياس الفعالية الإعلانية بواسطة المعطيات ذات المصدر الواحد:

### ٢-١- مفهوم معطيات «المصدر الواحد» single source:

يرتبط مفهوم المعطيات ذات المصدر الواحد أو الوحيد بالمعطيات التي تكون فيها سلوكية الشراء مقاسة من قبل عين الأشخاص (الذين ينتمون إلى عينة ممثلة للمجتمع المدروس) من خلال تعريضهم إلى وسائل الاتصال الإعلانية. بالإضافة إلى المعطيات الدقيقة عن البيع وعن الخصائص السكانية، الاجتماعية والمالية وحتى النفسية للمستهلكين المستهدفين، فإنه يتوافر الآن، في بعض الأنظمة، إمكانية الأخذ بعين الاعتبار للقطات التلفزيونية المشاهدة من قبل هؤلاء المستهلكين. حيث تتوافر آلة تسجيل متوسطة في جهاز استقبال التلفزيون تسمح بتسجيل القنوات المشاهدة مع التوقيت الدقيق ومن ثم معرفة الإعلانات المشاهدة من قبل الأسرة. وتتوافر أيضاً أدوات أخرى تسمح بمعرفة الفرد أو الأفراد من الأسرة الذين قد يكونون من عناصر المجموعة الاختبارية والذين يشاهدون لقطات إعلانية محددة.

وهكذا فإنه يتم استخدام قواعد المعطيات الضوئية المجمعة باستخدام النموذج Logit للتنبؤ بالمبيعات للمنتجات ذات الاستهلاك الكبير وبمستويات دقيقة. وتسمح هذه القواعد من المعطيات الضوئية بنمذجة الظواهر التالية<sup>(١)</sup>:

- تغيير اسم الماركة والعائد إلى التأثيرات الترويجية.
- تأثير عمليات الترويج الإعلانى، عندما تقود هذه الأخيرة إلى تضخيم المخزون لدى المستهلك (نمط الشراء أكبر من نمط الاستهلاك)، على المبيعات للفترات القادمة.
- تأثير مصداقية وإخلاص المستهلك. وهذه النقطة مهمة: لأنها تسمح بالتمييز بين المستهلك الوفى وبين المستهلك غير الوفى الذى يبدل نوع السلعة بسهولة. وتسمح هذه النقطة من ثم بإجراء معالجة منفصلة لكل نوع من النوعين السابقين فى إطار السياسة الترويجية والدعائية.

كما أن قواعد المعطيات الضوئية تسمح لنا بتقييم أفضل لبعض المرونة، وبشكل خاص مرونة حجم السعر، كما تسمح أيضاً بإمام أفضل لآلية اللعبة التنافسية من خلال دمج تأثير العروض الترويجية للمنافسين فى مبيعات المنشأة.

يجب الإشارة هنا إلى أن هذه الأدوات المخصصة باعتبارها هدفاً نهائياً لإجراء التنبؤ بالمبيعات، تستند إلى طريقة تجريبية تبدو منذ البداية أنها طرائق مساعدة لاتخاذ القرار. المقصود هنا هو مقارنة مجموعة من المستهلكين معرضين لحافز ما (إعلان، ترويج، ... إلخ) مقابل مجموعة مراقبة أخرى لا تخضع لأى معالجة تجريبية. فالشبكة عبر الكابلات التى تربط بين مدن مختلفة (مثلاً مدينة Angers فى حالة نظام BEHAVIORSCAN المشار إليه سابقاً) تسمح بالبحث التلفزيونى لدى عينة من الأسر للإعلانات التلفزيونية التى نرغب فى اختبارها. وهذه العينة من الأسر تكون مجهزة بعلبة خاصة تسمح لنا بمعرفة البرامج التى تتابعها هذه الأسر، ومن ثم معرفة الرسائل الإعلانية التى يشاهدونها، وبكوننا نمتلك معرفة تفصيلية عن مشترياتهم فإنه يصبح من السهل لنا ملاحظة التأثير لعمل أو حدث ما على مجموعة الاختبار مقابل مجموعة شاهدة أخرى غير معرضة لهذا الحافز.

يتم استخدام هذه النتائج فى إطار المساعدة على اتخاذ القرار ولكن، كما سنرى لاحقاً، يمكن أيضاً استخدامها للتنبؤ بالمبيعات.

(١) (Guadagni et Little (١٩٨٣)

## ٢-٢- الاختبارات للمنتجات الجديدة وللخطط التسويقية: مثال منتج بقالة جديد:

نبحث فى هذه الفقرة الحظوظ المتاحة لطرح منتج بقالة جديد فى السوق وإمكانية توسع سوقه إلى المستوى الوطنى، وذلك من خلال اختبار الخطة التسويقية لمرحلة طرح المنتج الممتدة لفترة ثمانية أسابيع. المتغيرات المأخوذة بعين الاعتبار هى تأثير الإعلان فى نجاح نوع المنتج (الماركة) وتأثير الخطة الترويجية. يبين الرسم التوضيحي (١) الخطة التجريبية. الهدف هنا هو اختبار التأثير لحملة إعلانية مكونة من (١٢٨٠) (١) GRP تجرى على فترة أربعة أسابيع من خلال مقارنتها مع مجموعة مراقبة غير معرضة لأى تأثير. فى الوقت نفسه يتم تعريض كلتا المجموعتين لأنماط مختلفة من التأثيرات الترويجية. وكون هذه الأخيرة تجرى على المحتويات الأساسية للمحل فإنه من غير الممكن معالجتها بطريقة تجريبية بحتة مع مجموعة مراقبة غير معرضة للحافز المشار إليه. وفيما يتعلق بالعمليات الترويجية فهى تعتبر شبه تجريبية، وتشمل الإجراءات الترويجية المختبرة داخل المخزن (in-store) مثل (TG) têtes de gondole «عبارة عن عينة من المنتج المراد الترويج له موضوعة على رؤوس الرفوف داخل المحلات التجارية الكبرى» والكراسات الدعائية للمنتج المراد تسويقه (P)، وكذلك توزيع العينات المجانية (E) واختبار البضاعة (تذوق) (D) وعملية "Stop rayon" (SR) التى تسمح بالإشارة إلى العروض الترويجية، ويمكن تثبيتها على الرفوف الداخلية وتلفت نظر المستهلك إلى هذه العروض. وفى الوقت نفسه هناك عملية التعويض عند الشراء بالرزم (on pack) التى تمتد لكامل الفترة المعتبرة دون أن نستطيع من ثم تقييم تأثيرها الخاص.

يقود الاختبار إلى التحقق بشكل أسبوعى خلال فترة ممتدة لثلاثة أشهر (١٣) أسبوعاً) من معدل الدخول أو الاختراق للمنتج الجديد ومن معدل إعادة الشراء للمنتج نفسه، وذلك عبر المقارنة بين الأسر المزودة بعلب المراقبة (أى المعرضة للحملة الدعائية من الأسبوع الثانى إلى الخامس)، وبين المجموعة الشاهدة غير المعرضة للحملة الدعائية التى ترغب المؤسسة فى اختبارها. النتائج معروضة فى الجدول رقم (٢).

يتم قياس النجاح النسبى للإجراءات الترويجية من خلال حساب الرقم القياسى للمبيعات حسب دليل كل مجموعة من المنتجات ولكل نوع «ماركة» للأسابيع دون وجود ترويج. ولقد تم تنفيذ كل إجراء ترويجى لفترة أسبوعين.

(١) تقاس قوة الحملة الإعلانية بالعدد الإجمالى للرسائل المستلمة من قبل مجموعة المستهدفين. أما ال GRP (Gross Rating Point) التى تمثل العدد الإجمالى للعروض المنسوبة إلى (١٠٠) شخص من المستهدفين فهى تخدم فى قياس قوة الحملة الإعلانية.

## الرسم التوضيحي رقم (١) الخطة التسويقية التجريبية

١٢	١١	١٠	٩	٨	٧	٦	٥	٤	٣	٢	١	أسبوع الاختبار
< ===== (حملة TV مكونة من ١٣٨٠ GRP للأسابيع من ٢ إلى ٥)												مجموعة الاختبار ٢٠٠٠ أسرة معرضة
بدون دعاية												المجموعة الشاهدة ١٠٠٠ أسرة غير معرضة
		TG P SR		TG E P		TG D	TG D	TG E		TG P		الإجراءات الترويجية (in-store)
عرض تعويض (١٠٠٪) مؤجل (على إجمالي الفترة المكونة من ١٢ أسبوعاً)												الإجراءات الترويجية (on pack)

## الجدول رقم (٢) الفعالية النسبية لمختلف الإجراءات الترويجية (الرقم القياسي للبيع ١٠٠)

الرقم القياسي للمبيعات ١٠٠ من أجل الأسابيع دون ترويج	العارض (D) TG +	الكراسات (P) TG + Stop rayon+	العينات (E) TG +	الكراسات (P) TG +	الكراسات (P)
الفئة (١٠٠)	٣٥٢	٢٤٥	١٩٩	١٩٤	١٣٢
الماركة (١٠٠)	٣٤٥	٢٠٦	١٣٠	١٧٠	١٠٩

تسمح البيانات المجمعة في الجدول رقم (٢) بالتأكد من فعالية الحملة الإعلانية التي تسهم في تطوير جاذبية الماركة الجديدة. ومن بين الإجراءات الترويجية نجد الإجراءات المختلطة الأكثر فعالية وبشكل خاص اللجوء في الوقت نفسه إلى استخدام العارض للبضاعة (D) و (TG).

الجدول رقم (٣) نتائج اختبار السوق

المتغير		حصة السوق (الحجم/المشتريات %)		النسبة المئوية لاختراق السوق		حجم الشراء التجميعي من قبل المشتري (باللترات)	
المجموعة	أسر معرضة للحملة	مجموعة شاهدة	أسر معرضة للحملة	مجموعة شاهدة	أسر معرضة للحملة	مجموعة شاهدة	المجموعة
المعطيات الرقم القياسي	١١.٢ ١٤٩	٧.٥ ١٠٠	٤.٠ ١٤٢	٢.٨ ١٠٠	٣.١٦ ١١٧	٢.٧ ١٠٠	

## ٢-٣- قياس الفعالية الإعلانية:

لقياس الفعالية الإعلانية نستخدم هنا ماركة ذات انتشار واسع في مجال الصناعات التجميلية، وتحتل منذ عدة سنوات المركز الثالث أو الرابع للنساء اللواتي من العمر (١٥) إلى (٢٤) سنة. ويرغب المسؤول التسويقي بتقييم التأثير لزيادة ملموسة في الميزانية الإعلانية التي تزداد من (٦٢٥) GRP إلى (١١٢٥) GRP (+ ٥٠٠ GRP أى ما يعادل + ٨٠٪)، وذلك ضمن افتراض زيادة معتدلة في الاستثمارات التسويقية. كما نرغب في تقييم نتائج الزيادة إلى (١٥٢٥) GRP في إطار زيادة قوية جدا في حصة الصوت<sup>(١)</sup> (+ ٩٠٠ GRP أى ما يعادل جداء الميزانية بمقدار ٢.٤). الغاية من هذه الدراسة هي قياس المساهمة الإعلانية في نجاح الماركة المستخدمة، وكذلك التنبؤ بقوة تأثيرها في حالة ارتفاع النفقات الإعلانية. تم إجراء الاختبار على (٧) محلات تجارية اختبارية (خمسة من النوع hypermarket واثنين من النوع supermarket)، واستمر لمدة (٢٠) أسبوعا. تشتمل الخطة التجريبية على ثلاث مجموعات ويتم تعريض مجموعة المراقبة إلى الإعلان بواقع (١٢٥) GRP للأسابيع الثلاثة الأولى ثم بواقع (٢٥٠) GRP للأسابيع من الرابع إلى السابع، وبواقع (٢٥٠) GRP في نهاية الفترة من الأسبوع السابع عشر إلى الأسبوع العشرين مما يمثل بالإجمالي ما مقداره (٦٢٥) GRP كجهود إعلانية حالية. يشير الجدول (٤) إلى التوزيع النسبي للجهود الإعلانية على مجموعتي الاختبار.

(١) تمثل حصة الصوت النسبة التي يمثلها منتج ما أو ماركة ما في الاستثمارات الإعلانية الإجمالية لفئة المنتج، وهي تقيس الشدة الإعلانية بالنسبة للمنافسين الآخرين.



الجدول رقم (٤) الجهود الإعلانية (ب GRP) والنتائج بدلالة عدد النقاط لحصة السوق (PM)

PM	١٧ إلى ٢٠	١٢ إلى ١٦	٨ إلى ١١	٤ إلى ٧	١ إلى ٣	أسبوع الاختبار
٨,٣	٢٥٠			٢٥٠	١٢٥	مجموعة المراقبة (٩٥٠ أسرة)
٨,٤	٢٥٠	٢٥٠	٢٥٠	٢٥٠	١٢٥	مجموعة الاختبار ١ (١٠٠٠ أسرة)
١٢,٦	٤٠٠	٢٥٠	٣٥٠	٤٠٠	١٢٥	مجموعة الاختبار ٢ (١٠٠٠ أسرة)

تشير النتائج لمجموعتي الاختبار من مقارنتها مع مجموعة المراقبة أن الزيادة المعتدلة للضغط الإعلاني لا تسمح للماركة المدروسة بنمو معنوي أو جوهري، فحصلتها في السوق لا تزداد إلا من (٨,٣) إلى (٨,٤)، وهذه الإضافة في الحصة لا تبرر الجهد الإعلاني الإضافي. أي (٥٠٠) GRP. بالمقابل فإن الفرضية الثانية أي الزيادة القوية جداً بالضغط الإعلاني أدت إلى زيادة محسوسة بشكل واضح لحصة السوق (أكثر من ٥٠٪). مع ذلك وعلى الرغم من أهمية هذا الجهد الإضافي فإن الخطر من تحرك المنافسين لزيادة استثماراتهم الإعلانية يمكن أن يقود هذه الماركة إلى التفكير بإعادة صياغة كاملة للتسويق المختلط بدلاً من الزيادة القوية جداً في ميزانيتها الإعلانية.

### ٣- التنبؤ السنوي بالمبيعات باستخدام قواعد المعطيات الضوئية:

#### ٣-١- قواعد المعطيات والمخطط العام للتنبؤ:

يلزم لإجراء التنبؤ بالمبيعات وجود السوق الاختباري الذي يغطي منطقة محدودة ومغلقة من السوق الكلي، ويلزم كذلك توافر الأدوات اللازمة للحصول على المعطيات وحيدة المصدر حول ذلك السوق. ولا تتم دراسة السوق الاختباري إلا من أجل عدد محدود من الأسابيع يتراوح بين (٢٠) إلى (٢٠)، بشكل عام وذلك بسبب تكلفته المرتفعة. من جهة أخرى، قد يحصل لأسباب مختلفة تعود إلى أوضاع محلية محددة أن يبتعد السياق المحدد للاختبار ولو بشكل جزئي عن الشروط الوطنية، ويجب في هذه الحالة إعادة توجيه وتصحيح هذه الانحرافات. أخيراً، قد تكون هناك بعض الإجراءات قد تم استخدامها على السوق الاختباري بشكل مبالغ به زيادة أو نقصاناً مقارنة بما سيكون عليه الحال بالنسبة للسوق الوطني، ومن ثم لا بد أيضاً من إعادة التوجيه والتصحيح.

وكما هو موضح من الرسم التوضيحي رقم (٢)، فإن التنبؤ السنوي باستخدام سوق اختباري ومعطيات ضوئية يتم عبر أربع مراحل. يجب أولاً تقدير المتوقع على أساس السوق الاختباري أى على أساس عدد السكان ومدة الاختبار ثم يجب اللجوء إلى شكلين من أشكال التصحيح واحد يتفق مع الإسقاط الزمنى والآخر مع الإسقاط الحيزي أو المكانى. الغاية النهائية هى الوصول إلى حجم المبيعات المتوقعة على المستوى الوطنى لمدة عام<sup>(١)</sup>.

### ٢-٣- الإسقاط للسوق الاختباري:

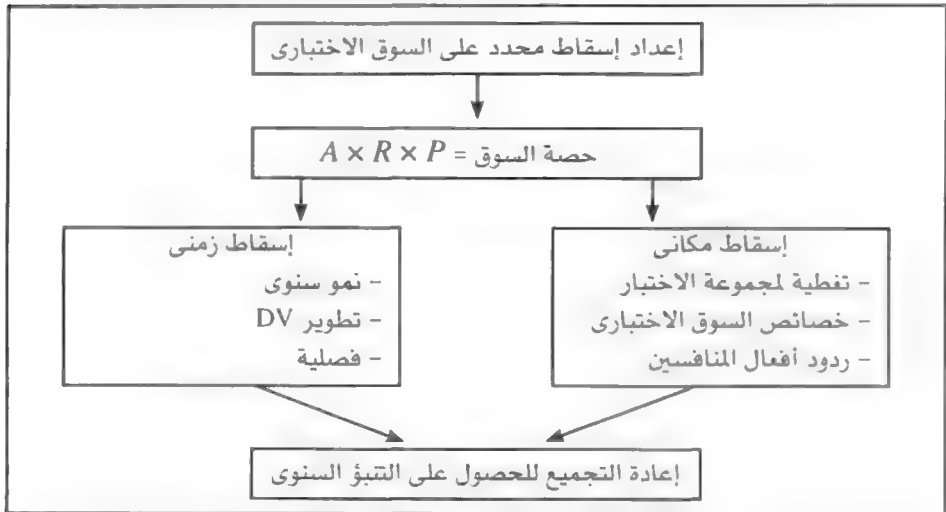
يمكن تقدير حصة السوق لمنتج جديد ما من خلال المعادلة التالية التى تمثل نموذج سلوكية المشتريين (نموذج ١٩٦٨، Parfitt et Collins):

$$A \times R \times P = \text{حصة السوق}$$

حيث:

تمثل P الدخول التراكمى للمنتج نحو السوق والناجم عن ميول المستهلكين إلى تجريب المنتج، وهو يقاس بنسبة المجربين للمنتج وسط مجموعة المشتريين لفئة المنتجات المنتمية للمنتج المدروس.

الرسم التوضيحي رقم (٢) العمليات المتتالية للحصول على التنبؤ السنوى بالمبيعات



(١) يستوحى العرض فى هذه الفقرة من مثال نظام التنبؤ السنوى Behavior scan Projection.

وتمثل  $R$  معدل إعادة الشراء، فبعد المحاولة الأولى قد يحجم المستهلك عن الشراء لهذا المنتج الجديد أو بالعكس سيعاود الشراء منه، وتقاس  $R$  بالنسبة من حجم المبيعات التي يخصصها المجرّبون لإعادة شراء المنتج من إجمالي فئة المنتج أما الباقي فيكون مخصصاً للماركات الأخرى للمنافسين (Merunka, ١٩٩٢).

أما  $A$  فتمثل مؤشر الشراء المعبر عنه بحجم الشراء.

هناك مجموعة من نماذج الإسقاط لسوق اختباري ما (Parfitt et Collins, Fourt-) (Woodlock, New One de Erim-Nielsen)، ولكن لها جميعها المبدأ نفسه أي إعادة تشكيل الداخلين إلى السوق ولحوادث الشراء في قاعدة البيانات الناتجة عن السوق الاختباري. فنموذج الدخول الذي يستخدم لتقدير ميول المستهلك لتجريب المنتج الجديد أو عدم تجربته يستند إلى مؤشرين أساسيين، نقطة الإشباع Point de saturation لاخترق السوق، وميل Pent تطور اخترق السوق الذي يعتبر دالة لحوافز السوق، وبشكل خاص الإجراءات الإعلانية والترويجية. وآلية عمل هذه النماذج مشابهة لآلية عمل النموذج المنطقي الذي تمّ التعرّض له في القسم الأول من الفصل السابع. ويعطى نموذج الاختراق للسوق تقديراً سنوياً لعدد المشتريين من الأسر مقارنة بعدد السكان العام. ويبقى أن نضيف هذا النموذج إلى نموذج وقائع الشراء السنوية لمشتري ما، والذي يمثل  $R$  و  $A$  في العلاقة السابقة.

من خلال نموذج وقائع الشراء يتم أولاً إيجاد نموذج لاحتمال إعادة الشراء ومن ثم تحديد الكميات المطلوبة لكل واقعة. ومن خلال التوفيق مع نتائج نموذج اختراق السوق يمكننا الوصول إلى إسقاط أولى للكميات السنوية، بمستوى  $DV$  مساوٍ لـ (١٠٠) (يعتبر المنتج متوافراً في مجموع المحلات التجارية على المستوى الوطني)، وفقاً للتسويق المختلط الأمثل، ومع إهمالنا لبعض العوامل مثل التغطية المكانية لمجموعة الاختبار والمركبة الزمنية الفصلية التي تستوجب إجراء تصحيحات زمنية ومكانية. (المخطط ٢).

### ٣-٣- التصحيحات الزمنية والمكانية وإعادة التجميع للحصول على التنبؤ لمدة عام:

إن دخول المنتج الجديد حيز التوزيع لا يتم بشكل فوري أو لحظي وإنما يخضع لعمليات تعريف متتالية من قبل المجمعات التجارية الكبرى (hypermarket أو supermarket) مما يستلزم إجراء تصحيحات أولية تأخذ بعين الاعتبار هذه الفروقات المكانية. ومن ثم فإن المنشأة ستعمل على صياغة عدة فرضيات لآلية تشكيل الـ  $DV$

(واقعية، تفاؤلية، تشاؤمية) ومن ثم سيكون لهذه الافتراضات تأثير فى التنبؤ حسب سرعة دخول المنتج الجديد شبكة التوزيع. التصحيحات التى يتم استخدامها تكون ذات علاقة بمشتريات الأسر غير المنتمة إلى مجموعة المراقبة وبنوعية الأماكن المؤثرة فى سلوكية المستهلك وتؤدى بمجملها إلى وجود تحيز جزئى فى التقدير<sup>(١)</sup>. يتم حساب التصحيحات على معطيات مجموعات الاختبار الخاصة بالتوزيع مثل Info scan d'IRI-Secodip أو Scantrack de Nielsen.

يتم إجراء نوع آخر من التصحيح على العوامل الزمنية ويرتكز بشكل أساسى على عنصرين اثنين: واحد يتعلق بمركبة الاتجاه العام، والآخر بالمركبة الفصلية (تم مناقشة هذه المركبات عدة مرات فى الفصول السابقة). فمعدل النمو للسوق يدخل فى صيغ حساب التنبؤ وفقاً لشكل النمو لمجموعة المنتجات فى فئته، فى حين يتم تطبيق المعاملات الفصلية من أجل الأخذ بعين الاعتبار للحوادث التى حصلت خلال فترة اختبار السوق. فقد يحصل أن تكون الفترة المدروسة تتعلق بموسم معين مما ينعكس إيجاباً أو سلباً على مشتريات المستهلكين، ومن ثم لا بد من إجراء تصحيح ما. ويمكن حساب المعاملات الفصلية باستخدام السلاسل الزمنية الطويلة المكونة من معطيات مجموعات الاختبار لسنوات عدة. أخيراً بعد الانتهاء من عمليات التصحيح يتم إعادة جمع البيانات بغية الحصول على تنبؤات لحجم المبيعات السنوى على المستوى الوطنى.

#### ٤- التنبؤ بصدق (إخلاص) الزبائن:

يعود الفضل فى توافر كميات كبيرة من البيانات المفيدة للتحليل إلى قواعد البيانات الضوئية وإلى عمليات التحسين والتطوير المستمرة للأدوات الإحصائية المتاحة، وكذلك إلى استطلاعات الرأى. ولقد تم مؤخراً اللجوء إلى تقنيات تسمى data mining التى يعرفها (١٩٩٨) Jumbu بأنها عملية تحويل وتقييم (إعطاء قيمة) للمعطيات الموجهة لغاية ما للمنشأة، باستخدام تحليل متقدم وذكى للمعطيات عبر مجموعة من طرائق معالجة تحليل البيانات (من التمثيل البيانى البسيط وصولاً إلى طرائق شبكات الأعصاب المعقدة). وتعتبر عملية data mining عملية تكرارية للمعالجة وللحكم على المعطيات، وتسمح عبر خطوات متتالية بالوصول إلى أداة للقرار الواجب اتخاذه على مستوى إدارة المؤسسة. نعرض فيما يلى مثلاً يتعلق بالتنبؤ بإخلاص أو وفاء الزبائن

(١) أظهر (١٩٩٦) Pourtant, Gupta *et al.* أنه رغم أن الأسر المختبرة بعيدة عن كونها ممثلة لإجمالى الأسر فإن المرونة السعرية المقدرة على أساس معطيات مجموعات الاختبار تكون قريبة جداً من تلك التى تم الحصول عليها بطرق أخرى.

والمأخوذ من مقالة (Jumbu ١٩٩٨). ونستطيع من خلال الرسم التوضيحي رقم (٣) التعرف على المراحل المختلفة لهذه العملية.

الرسم التوضيحي رقم (٣) التقدير والتنبؤ بإخلاص الزبائن باستخدام data mining



#### ١-٤- تحليل إخلاص (وفاء) الزبائن:

ندرس في المرحلة الأولى مجموعة المتغيرات التفسيرية ذات العلاقة بموضوع إخلاص الزبائن. ويعتبر المتغير التفسيري متغيراً ثنائياً التصنيف (القيمة (١) مخلص والقيمة (٠) غير مخلص)، ويتم وضع الزبائن على أسطر والمتغيرات الكمية (مثل العمر أو الدخل) والنوعية (مثل الجنس) على الأعمدة. الفاية الابتدائية هنا هي في دراسة العلاقة بين هذه المتغيرات والإخلاص باستخدام معاملات الارتباط (بالنسبة للمتغيرات الكمية) واختبار كاي مربع المعيارى للمعطيات النوعية. ومن خلال استخدام طرائق تحليل التوافق المتعدد نستطيع الوصول إلى طريقة أولى منهجية للإخلاص من خلال محاولة الكشف عن فئات من الزبائن متجانسة حول مجموعة محددة من المتغيرات التفسيرية، ومن ثم لهم سلوكية متشابهة بخصوص الإخلاص.

في المرحلة الثانية نحاول تكوين نموذج يسمح بتقدير مؤشر الإخلاص للزبائن ومن ثم التنبؤ به. وهناك طريقة كلاسيكية للوصول إلى هذا المؤشر عبر طريقة نموذج Logit الذى سبق شرحه فى الفقرة (٢-١) من هذا الفصل، حيث تكون المتغيرات التفسيرية تلك المعروضة فى المرحلة الأولى، وهى التى ثبتت علاقتها مع الإخلاص. التحليل التمييزى analyse discriminante يعتبر بديلاً لنموذج Logit ويسمح بحساب تابع للمتغيرات التفسيرية الذى يصنف بطريقة مثالية الأفراد بين فئتين (مخلصين/ غير مخلصين). أخيراً هناك إمكانية لتحليل جداول العلاقة الارتباطية بواسطة تحليل التوافق (AFTL)، حيث نعزل وبشكل نهائى محوراً وحيداً يقابل المخلصين إلى غير المخلصين، ويمكننا عندئذ اختيار عدد المتغيرات المعتبرة بطريقة تجعل عدد الأفراد المصنفين أفضل ما يمكن.

#### ٢-٤- القيمة الاقتصادية للزبائن:

نستخدم فى المرحلة (٢) العلاقة المستخدمة من قبل المختصين لحساب القيمة الاقتصادية للزبون (Jumbu, ١٩٩٨, p. ٧٤):

$$I_{vc} = a \left( A + \sum_{i=1, p} (F_i - C_i) \right)$$

حيث

$I_{vc}$ : مؤشر القيمة الاقتصادية.

$\alpha$ : التثقيل المتماثل لإجمالى الزبائن.

$A$ : تكلفة كسب زبون.

$F_i$ : مبلغ الفاتورة الشهرية و  $C_i$  تكلفة خدمة الزبون.

$P$ : عدد الأشهر لبقاء الزبون مخلصاً لمؤسسته.

هناك مشكلة عملية تتعلق بتقدير فترة الحياة للزبائن وهذه الفترة يمكن تقديرها باستخدام التحليل الشعاعى التوافقى وباستخدام منحنيات lift (من أجل التفاصيل يمكن العودة لمقالة Jumbu, ١٩٩٨, p. ٧٥).

#### ٤-٣- القيمة الاقتصادية وإدارة إخلاص الزبائن:

فى المرحلة (٤) يكفيننا من أجل التنبؤ بمؤشر إخلاص الزبائن بعض المعطيات البسيطة والعملية مثل نمط السكن أو العمر. وفى هذا التنبؤ يتم حسب خصائص أفراد المجتمع الذين سيتم عليهم التنبؤ. ويكفى على سبيل المثال استخدام نموذج الانحدار المنطقى المقدر فى المرحلة (٢) مع قواعد هذه المعطيات. وبالطريقة نفسها يتم التنبؤ بفترة حياة الزبائن انطلاقاً من قيم المتغيرات التفسيرية المكتشفة فى المرحلة السابقة. مع الأخذ بعين الاعتبار تأثير كل متغير من هذه المتغيرات التفسيرية على تباين متغير إخلاص الزبائن. لا بد من الإشارة إلى أن أنماط المتغيرات التفسيرية تؤثر فى زيادة أو تقليص فترة حياة الزبون.

فى المرحلة الخامسة تسمح إدارة إخلاص الزبائن للمسؤول التسويقى بإنشاء خطة حقيقية للتحرك مستندة إلى مجموعة من المتغيرات. متغيرات ديموغرافية اجتماعية تفسر الإخلاص ومعطيات تتعلق بموضوع الفواتير وبمؤشر الإخلاص للزبون وبفترة الحياة المقدرة. وبمؤشر قيمته الاقتصادية. ويتم التعامل مع هذه المعطيات والاستفادة منها بطريقتين تقنيتين، الأولى تتم بشكل إفرادى على مستوى الزبون الواحد؛ إذ يكفى فقط الضغط على النقطة الممثلة للزبون على الرسم البيانى حتى يتم الحصول على المعلومات المطلوبة، والثانية تقضى بتجميع الزبائن على رسم بيانى واحد تبعاً لمؤشر الإخلاص وللمؤشر القيمة الاقتصادية. ويسمح هذا الإجراء برؤية تفصيلية، من خلال الرسم البيانى، لتجمعات الزبائن حسب خصائصهم المتعلقة بموضوع الوفاء للسلعة فعلى سبيل المثال يمكننا رؤية المخلصين الذين لديهم قيمة اقتصادية قليلة مقابل الزبائن غير المخلصين، ولكنهم يمتلكون قيمة اقتصادية مرتفعة، ومن ثم لا بد من خطة تحرك من أجل هؤلاء.

بقى أن نشير إلى الدور الذى تلعبه تقنيات أساليب معالجة البيانات المتعلقة بالمستهلكين فى عملية تقييم تأثير الإجراءات الإعلانية والترويجية على التنبؤ بالمبيعات، وتبقى صعوبة الأخذ بعين الاعتبار لقرارات المستهلك ولعدد المتغيرات المؤثرة فيه (مكونات المزيج التسويقي: السعر، المنتج، الإعلان والترويج) كافية لجعل عملية التنبؤ بالمبيعات صعبة التحقيق. وهناك واحدة من الصعوبات العملية بهذا الشأن تتعلق بآلية اللعبة التنافسية التى تجعل من التنبؤ الصحيح تنبؤاً غير مؤكد بسبب التعديلات الجوهرية التى تتم من قبل منافس أو مجموعة من المنافسين على برامج تحركهم التسويقية.





## الفصل التاسع

### التنبؤ للمجالات الزمنية القصيرة جداً ضمن شروط خاصة

سنعالج في هذا الفصل مسائل التنبؤ المتعلقة بالمجالات الزمنية القصيرة وبأنشطة خاصة وتشمل:

- التنبؤ بالأنشطة اليومية في مجال الخدمات أو المنتجات من خلال مثال يتعلق بإنشاء نظام للتنبؤ بعدد زائري برج إيفل.

- التنبؤ للسلع ذات مدد الحياة المحدودة وبشكل خاص السلع الفصلية كتلك المتعلقة بتصميمات الأزياء من الملابس الموسمية وذلك من خلال نظام للتنبؤ مخصص لهذا القطاع.

رغم استخدامنا للوسائل نفسها المستخدمة سابقاً إلا أن تطبيقاتها في هذه الظروف غير المعيارية تجعل من الضروري إعادة صياغتها.

#### ١- التنبؤ بالأنشطة اليومية:

##### ١-١- عرض المشكلة:

يعتمد المجال الزمني للتنبؤ على نوع ونمط النشاط الذي تمارسه المؤسسة ويكون هذا المجال بالنسبة لمعظم المؤسسات قصيراً أو متوسط الأجل، وقد تكون الفائدة قليلة بالنسبة لبعض القطاعات التي تُجرى التنبؤات طويلة الأجل، بشكل تجميعي (كل شهر). ولنأخذ مثلاً يتعلق بقطاع المطاعم الصغيرة، من النوع المسمى «كافيتريا» حيث يتوجب على القائمين على هذه المنشأة التنبؤ في نهاية كل أسبوع بعدد الأطباق التي سيقدمها في الأيام الخمسة عشر القادمة، ولكلتا الفترتين الصباحية والمسائية. ولا شك أن دقة التنبؤ بالنسبة له مهمة جداً كونه يقوم بعملية إزالة التجميد عن الأغذية صباحاً، ومن ثم فإن الفائض غير المستهلك سيتم التخلص منه لأسباب صحية أو غيرها. بالإضافة إلى ذلك فإنه يتم تمرير الطلبات من المواد في بداية كل أسبوع وفي حالة الفائض أو النقص في المخزون فإن المنشأة ستتكبّد خسائر كبيرة.

لنأخذ مجالاً آخر يتعلق بالعمل في المخازن أو المجمعات الكبرى hypermarket حيث إن هناك تشريعاً صارماً بخصوص عمل الأفراد في صناديق المحاسبة. ويعتبر

التنبؤ بعدد العربات المارة بالصندوق بشكل ساعىً ذا فائدة كبيرة لمدير المجمع، حيث يستطيع فى هذه الحالة وضع خطط لفتح الصناديق حسب الحاجة بغية تقليل فترة انتظار الزبون، وكذلك تقليص أجور اليد العاملة.

مثال آخر يتعلق بالصحافة، فمن المعلوم أن عدد النسخ المطبوعة من صحيفة ما يخضع لمجموعة من العوامل مثل عدد قراء تلك الصحيفة، والفترة الزمنية للتوزيع، وكذلك حصول بعض الحوادث الاستثنائية الاقتصادية أو السياسية التى تجلب عدداً جديداً من القراء. ومن المعلوم أيضاً أن لكل عدد غير مباع من الصحيفة قيمة متبقية معدومة تقريباً، وذلك اعتباراً من اليوم التالى بالنسبة للصحف اليومية واعتباراً من الأسبوع التالى بالنسبة للصحف الأسبوعية. كما أنه يتوجب على إدارة الصحيفة فى حال رغبت فى توزيعها فى منطقة ما - أن توزع بشكل مجانى عدداً من النسخ لبائعى الصحف الذين لا يقبلون بأى خسارة تلحق بهم جراء عدم بيع كل النسخ الموجودة لديهم. لذلك ومن خلال التنبؤ بدقة للأعداد المباعة حسب المناطق وحسب الأيام فإن إدارة النشر ستخفض عدد النسخ غير المباعة إلى الحد الأدنى وبالنسبة لتقلص النفقات.

مجال آخر يتعلق بقطاع الاتصالات وبشكل خاص يتعلق بالعاملين لدى المنشآت المكلفين بالردود الهاتفية لاتصالات الزبائن ومساعدتهم، حيث يمكننا من خلال التنبؤ بعدد الاتصالات بشكل يومى وساعىً تقليص الكثير من النفقات فى أجور اليد العاملة. من هنا تأتى أهمية تزويد المنشأة بنظام تنبؤ ملائم.

من خلال الأمثلة السابقة تتضح لنا الحاجة إلى نظام تنبؤ يسمح بإجراء التوقعات اليومية أو حتى الساعية لأرقام نشاط هذه المؤسسات. هناك أيضاً قطاعات أخرى معنية بهذا النمط من التنبؤ مثل محطات التزويد بالوقود والكهرباء ومكاتب تأجير السيارات وغيرها.

## ٢-١- المنهجية العامة:

تستند طريقة التنبؤ قصير الأجل على تحليل دقيق للسلاسل الزمنية الشهرية أو الأسبوعية أو حتى اليومية، وهى من ثم تستخدم توفيقاً للطريقة الداخلية (توزيع السلسلة إلى مكوناتها الأصلية) وللطريقة الخارجية (أى البحث عن متغيرات تفسيرية خارجية مثل الأحوال الجوية والمتغيرات الصامتة المرتبطة بالحوادث الاستثنائية). وليس المقصود هنا هو عملية تقسيم للتنبؤات الشهرية إلى تنبؤات أسبوعية وبعد

ذلك إلى تنبؤات يومية، ولكن تحديد المكونات الفصلية الخاصة بكل مركبة من مركبات السلسلة الزمنية. سوف نعرض بالتفصيل مثلاً لنظام التنبؤ الذى يسمح لنا بالتنبؤ وبشكل يومية بعدد زوار برج إيفل فى باريس (أى عدد بطاقات الدخول المباعة يومياً).

## ٢-٢- مثال تطبيقي: كم عدد زوار برج إيفل؟

### ١-٢- إطار الدراسة:

يعتبر برج إيفل من أكثر المعالم زيارة فى العاصمة الفرنسية باريس، ويؤمه الزوار صيفاً وشتاءً. ويوجد أربعة مصاعد متاحة لهذا البرج ولكن ثلاثة فقط منها متاحة للاستخدام، وذلك لأسباب تتعلق بالأمان حيث يخصص الرابع لحالات الإخلاء والإنقاذ.

ترغب الشركة المستثمرة لهذا البرج فى تحسين الخدمات للزوار بحيث تقلل ساعات الانتظار ومن أجل ذلك ترغب فى تحديد عدد المصاعد الواجب استخدامها، وكذلك عدد صناديق بيع تذاكر الدخول.

الهدف هنا هو إمكانية التنبؤ بعدد الزوار اليومي لفترة زمنية تمتد إلى (٢٥) يوماً بدقة كافية تمكن الشركة المستثمرة من معرفة عدد المصاعد اللازم وضعها قيد الاستخدام. وفى هذا السياق ليس المهم قيمة التنبؤ بعينها، وإنما مجال الثقة فى هذا التنبؤ. وذلك لأن فتح أى مصعد إضافي يكون خاضعاً لبلوغ درجات الذروة من عدد الزوار. وتظهر الصعوبة لإنشاء نظام التنبؤ بشكل واضح فى أيام نهاية الأسبوع وخلال الأعياد.

سنعرض بالتفصيل آلية إنشاء هذا التنبؤ.

### ٢-٢- التحليل الداخلى للسلسلة الزمنية:

المجال الزمنى لهذه الدراسة هو عام ١٩٩٦م والمعطيات المتاحة تتعلق بأعداد الزوار الأسبوعية من الأسبوع الأول من العام ١٩٩٣م إلى الأسبوع (٥٢) من العام ١٩٩٥م، وكذلك لدينا معطيات يومية عن عدد الزوار للفترة الممتدة من الأول من شهر كانون الثانى لعام ١٩٩٣م إلى (٣١) كانون أول من العام ١٩٩٥م. يقضى التحليل الداخلى

بالبحث عن العناصر المتكررة فى سياق المعطيات التى يمكن أن يعتمد عليها فى عمليات التمديد الخارجى للمعطيات بهدف الحصول على التنبؤ المطلوب. أى إننا بحاجة إلى معرفة المكونات الفصلية الأسبوعية واليومية.

## ٢-١- تصحيح أشهر تشرين الثانى وكانون أول من العام ١٩٩٥م:

هناك تأثير حصل فى شهرى تشرين الثانى وكانون الأول من العام ١٩٩٥م بسبب حركات الإضراب فى وسائل النقل، ولذلك من الضرورى تصحيح أيام هذه الحوادث الاستثنائية من خلال استبدالها بقيمها المتوقعة. وهذا التصحيح يتم على مرحلتين:

### - التنبؤ الشهرى بالزوار لشهرى تشرين الثانى وكانون الأول من العام ١٩٩٥م:

باستخدام طريقة للتمدید الخارجى لمركبة الاتجاه العام وللمركبة الفصلية تم إجراء تنبؤ لهذين الشهرين من العام ١٩٩٥م.

القيم المحققة	القيم المصححة	
٢٢٨٠١٩	٢٣٢٢٨٢	تشرين الثانى ١٩٩٥
٢٠٣٧٩٧	٢٠٣٠٧٣	كانون الأول ١٩٩٥

### - تصحيح الانحرافات أسبوعياً:

بعد الحصول على التنبؤات الشهرية السابقة تم اللجوء إلى تقسيمها بشكل أسبوعى تبعاً للأوزان النسبية للأسبوع المعتبر فى السنة (الجدول رقم ١).

الجدول رقم (١) تصحيح المسار الزمنى للسلسلة

أسابيع عام ١٩٩٥	القيم المحققة	القيم المصححة
٤٧	٣٩٤٤٥	٥٩١٦٨
٤٨	٢٨٤٨٤	٤٢٧٢٦
٤٩	٢٨٤٣٥	٤٢٦٣٨
٥٠	١٩١٨٩	٤٧٩٧٣
٥١	٣٩٥٨٧	٥٩٣٨١
٥٢	١٠٠٠٨٢	١٠٠٠٨٢

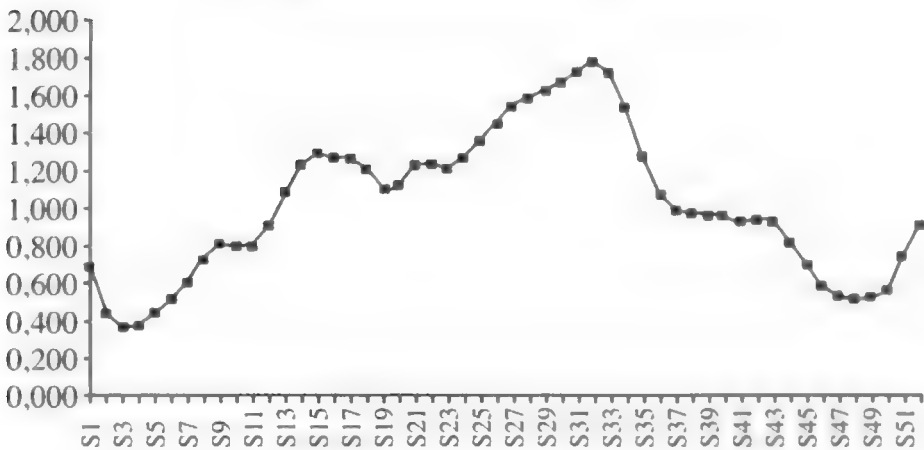
## ٢-٢-٢- حساب المركبة الفصلية الأسبوعية:

يتم في المرحلة الأولى حساب المركبة الفصلية الأسبوعية وتقود الطريقة المستخدمة إلى إجراء الحسابات التالية، وذلك من خلال استخدام المعطيات الأسبوعية للسلسلة على مدار ثلاث سنوات:

- حساب المتوسط المتحرك من الدرجة (٢) وذلك بهدف صقل المعطيات الأسبوعية المتحركة من عام إلى آخر.
- حساب المتوسط المتحرك من الدرجة (٥٢) (المتوسط المتحرك يكون إذن خارج الظاهرة الفصلية الأسبوعية).
- حساب نسبة التكرارات المشاهدة للزيارة إلى المتوسط المتحرك (باستخدام صيغة الجداء).
- حساب المتوسط للنسب للأسبوع نفسه.
- معايرة المعاملات.

يعبر عن المعاملات الفصلية التي عددها (٥٢) والظاهرة في الشكل البياني رقم (١) بنسب مئوية منسوبة إلى الأسبوع المتوسط (فعلى سبيل المثال معامل الأسبوع (٣٢) هو (١,٧٨)، وهذا يعني أن الأسبوع (٣٢) هو (١,٧٨) مرة أكبر من الأسبوع المتوسط). نستخلص من ذلك الشكل ارتفاعاً كبيراً بحركة الزيارة للأسابيع (٣١)، (٣٢) و(٣٣) المتعلقة بشهر أغسطس (آب). في حين تكون الأشهر الأقل تكراراً هي تلك المتوضعة في بداية العام.

الشكل البياني رقم (١) المعاملات الفصلية الأسبوعية



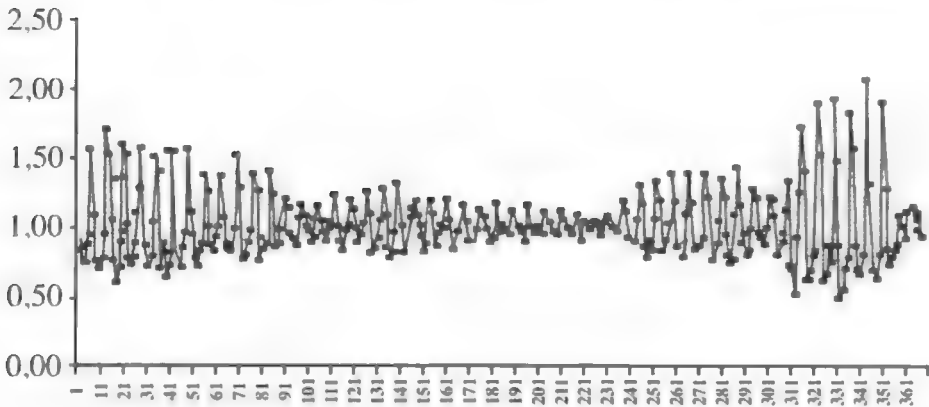
## ٢-٣- حساب المركبة الفصلية اليومية:

يمكننا من خلال المعطيات اليومية المتوافرة على مدى ثلاث سنوات وثلاثة أشهر (أى من كانون ثانى ١٩٩٢م إلى آذار ١٩٩٦م) تقدير المعاملات الفصلية اليومية البالغة (٣٦٥) معاملاً بواسطة تتابع عمليات الحساب التالية:

- الوسط المتحرك من الدرجة (٧) (الوسط المتحرك هو إذن خارج الظاهرة الفصلية اليومية).
- حساب نسبة تكرارات المشاهدة للزيارة إلى المتوسط المتحرك.
- حساب متوسط النسب على ثلاث سنوات بهدف حذف التقلبات العشوائية الناجمة من أسبوع إلى آخر.

نلاحظ بأنه، خلال فصل الصيف، تتلاشى المركبات الفصلية اليومية لأسابيع شهرى تموز وآب المتوضعة فى وسط الشكل البيانى رقم (٢) (حيث ينعدم الفرق أو ربما يوجد القليل منه بين يومى الأحد والإثنين على سبيل المثال) فى حين أن الفرق واضح جداً خلال الفترة الشتوية (بداية الشكل البيانى).

الشكل البيانى رقم (٢) المعاملات الفصلية اليومية



## ٢-٤- حساب السلاسل الزمنية المصححة من التقلبات الفصلية CVS الأسبوعية واليومية:

بعد حساب المعاملات الفصلية الأسبوعية واليومية نجرى عملية حذف لهذه المركبات من السلسلة الزمنية الخام للفترة من الأول من كانون الثانى ١٩٩٥ إلى الثلاثين من شهر آذار عام ١٩٩٦م، ونحسب بعد ذلك معاملات الاختلاف Coefficients of variation لهذه السلاسل الثلاث (الجدول ٢).

الجدول رقم (٢) معامل الاختلاف للسلاسل الخام، المصححة من التقلبات الفصلية اليومية ومن التقلبات الأسبوعية

المتوسط	السلسلة الخام	السلسلة المصححة من التقلبات اليومية	السلسلة المصححة من التقلبات الأسبوعية
١٣١٩٤	١٣٤٣٣	١٤١٣٧	
٦٩٢٨	٦٢٩٧	٣٠٦١	
٠,٥٣	٠,٤٧	٠,٢٢	

نلاحظ من الجدول السابق أن المعطيات المصححة من التقلبات الأسبوعية واليومية ثابتة نسبياً، فمعامل الاختلاف الذي يمثل النسبة ما بين الانحراف المعياري إلى المتوسط الحسابي ينقص من (٠,٥٣) إلى (٠,٢٢). ومن ثم فإن التحليل البسيط للمركبة الفصلية قد خفض بشكل ملموس التباين لسلسلة زوار برج إيفل.

## ٢-٣- تحليل الظواهر الخارجية:

بعد أن تم التخلص من الظواهر الداخلية الفصلية نبحث الآن عن العناصر التفسيرية الخارجية التي يمكن أن تلعب دوراً في شرح التقلبات في حركة الزوار.

### ٢-٣-١- تحليل الارتباط:

تم تصنيف المتغيرات الخارجية التي يمكن أن تلعب دوراً في حركة زوار برج إيفل وفق الأنماط التالية:

- نمط يوم العطلة: الأول من كانون الثاني، (١٤) تموز، الأول من أيار... إلخ، ومن أجل ذلك تم استخدام المتغير الثنائي الذي يأخذ القيمتين (١) أو (٠) (وجود أو عدم وجود يوم عطلة، ومن ثم فإن الفرضية المعمول بها هي أن لكل يوم عطلة التأثير نفسه في السلسلة المصححة من التغيرات الفصلية أي السلسلة CVS، ونشير إلى هذا المتغير بالرمز (TYPJOUR).

- المتغيرات المناخية<sup>(١)</sup> (حسب مناخ المنطقة الباريسية):

- فترة التشمس الصباحية وبعد الظهر مقاسة بالدقائق (يشار إلى هذه المتغيرات بالرموز ENSMA و ENSAPM).

(١) الغاية من استخدام التغيرات المناخية هي تصحيح السلسلة الزمنية من القيم غير الطبيعية المرتفعة أو المنخفضة بسبب الظواهر المناخية وبدون هذا التصحيح لن تكون حركة الاتجاه العام واضحة.



- المطر في الصباح وبعد الظهر مقاساً بالمليمتر (يشار إلى هذه المتغيرات بالرموز PRECIPMA و PRECIPAPM).
  - الرياح (سرعتها بالكيلومتر / الساعة).
  - درجة الحرارة (المقاسة ست مرات يومياً والمشار إليها بالرمز من T1 إلى T6).
  - الثلج (باستخدام متغير صامت يأخذ القيمة (١) ليوم الثلج والقيمة صفر لعدمه).
- لقد تم تلخيص معاملات الارتباط البسيط بين المعطيات المصححة من التقلبات الفصلية CVS والعناصر التفسيرية المشار إليها أعلاه في الجدول رقم (٣) التالي:

الجدول رقم (٣) نتائج حساب معاملات الارتباط

مؤشر اختبار ستيودنت ١	معامل الارتباط	المتغير التفسيري
٢,٩٠	٠,١٥	ENSMA
٢,٩٨	٠,١٦	ENSAPM
٣,٥٥	٠,١٩	TYPJOUR
٣,١٤-	٠,٢٦-	PRECIPMA
٢,٥١-	٠,١٩-	PRECIPAPM
٣,١٠-	٠,١٦-	NEIGE
٠,٥٠-	٠,٠٣-	VENT
١,٠٤-	٠,٠٥-	T١
١,٧٦-	٠,٠٩-	T٢
١,٠١-	٠,٠٥-	T٣
٠,٧٧-	٠,٠٤-	T٤
١,٢٧-	٠,٠٧-	T٥
٢,٣٩-	٠,١٣-	T٦

تشير قيم مؤشر ستيودنت الأكبر من القيمة الجدولية (١,٩٦) بالقيمة المطلقة إلى وجود ارتباط معنوي.

### ٢-٣-٢- إيجاد النموذج الرياضي:

مما سبق نستخلص وجود بعض المتغيرات التفسيرية الدالة إحصائياً ويبدو عملياً من المستحيل إدخال كل هذه المتغيرات في نموذج واحد خشية الحصول على ارتباط قوى بين المتغيرات التفسيرية فيما بينها، ومن ثم إمكانية تفسير هذه المتغيرات للظاهرة نفسها، وهذا ما يسمى Colinéarité.

لذلك ومن خلال اتباع طريقة لانتقاء المتغيرات الخارجية الأكثر تفسيراً (الانحدار بخطوات Stage wise Regression)<sup>(١)</sup> نحصل على النموذج التالي المقدر بواسطة البرنامج إكسل (الجدول رقم ٤):

$$FREQCVS = 14702.3 - 1421.3 \times NEIGE - 330.3 \times PRECIPAPM - 490 \times PRECIPMA + 3183 \times TYPJO$$

وحيث  $R^2 = 0.13$ ,  $n = 364$

FREQCVS = أعداد الزوار المصححة من التقلبات الفصلية.

الجدول رقم (٤) نتائج التقدير الإحصائي

الحد الثابت	TYPJO	PRECIPMA	PRECIPAPM	NEIGE	المتغير التفسيري
١٤٧٠٢,٢٨	٣١٨٣,٠١	٤٩٠,٩١-	٣٣٠,٢٨-	١٤٢١,٣٥-	قيمة العامل
١٣٧,٠٧	٨٧٩,٠٥	١١٧,٤٥	١٣٢,٢٦	٧٢١,٨٧	الانحراف المعياري
				$R^2 = 0.13$	معامل التحديد
١٠٧,٢٥	٣,٦٢	٤,١٧-	٢,٤٩-	١,٩٦-	مؤشر ستيودنت ١
	٢١,٦٥	٣,٣٤-	٢,٢٥-	٩,٦٧-	% (العامل/الثابت)

لكي يكون المتغير تفسيرياً يجب أن تكون قيمة مؤشر ستيودنت أكبر من القيمة الجدولية (١.٩٦).

نلاحظ من خلال نتائج النموذج المقدر أن إشارات المعالم تتفق مع الواقع:

- فيوم الثلج يقود إلى خسارة (٩,٦٧٪) من الزوار  $(\frac{1421.3}{14702.3} = 9.67)$ .
- والمطر بعد الظهر يقود إلى فقدان (٢,٢٥٪) من الزوار لكل ميليمتر من الهطل المطري.
- والمطر الصباحي يقود إلى فقدان (٣,٣٤٪) من الزوار لكل ميليمتر من الهطل المطري.
- ويوم عطلة استثنائي يقود إلى زيادة الزوار بمعدل (٢١,٦٥٪).

(١) تسمح هذه الطريقة بانتقاء المتغيرات الأكثر تفسيراً للتقلبات في عدد الزوار (انظر الفصل الرابع).

فى حال كان المطر شديداً فى الصباح فإن وكلاء مكاتب السياحة يعدلون برامج الزيارات بحيث يتجنبون الزيارات الخارجية (فى الهواء الطلق) ويستبدلون بها زيارات داخلية. فعوضاً عن زيارة برج إيفل على سبيل المثال يمكن زيارة قصر فرساي. بالمقابل إذا كان المطر فقط لفترة بعد الظهر، فيمكن تنظيم الزيارات ويكون التأثير فى حركة الزوار أقل.

وبالبحث عن كمية المطر العظمى خلال العام ١٩٩٥م (فى الصباح وبعد الظهر) يكون التأثير لكلا الفترتين على حركة الزوار متمثلاً بفقدان (٢٠,٢) و (١٢,٤)٪ على التوالي أى ما مجمله (٣٢,٧)٪.

بتحليل آخر مماثل للسابق ولفترة ثلاث سنوات (١٠٩٠ مشاهدة) تم إدخال متغير تفسيرى جديد يتعلق بزوار المعرض الزراعى SALON agriculture<sup>(١)</sup> ويأخذ هذا المتغير الجديد القيمة (٠) لكل الأيام ما عدا أيام فتح المعرض أمام الزوار حيث يأخذ القيمة (١). النتائج معروضة فى الجدول رقم (٥) التالى:

الجدول رقم (٥) نتائج التقدير للنموذج مع متغير معرض الزراعة

المتغيرات	SALON	PRECIPAPM	PRECIPMA	TYPJOUR	NEIGE	TC
المعامل	١٨٠٣,٠٥٥	-١٣٤,٤٢	-٢٠٥,٥١	١١١٩,٤٣	-١٧٥٧,٧٢	١٤٨٢٦,٩٢
مؤشر ستيودنت t	٤,١٣	-١,٧٧	-٣,٢٥	٢,٨١	-٣,٣٩	
٪	١٢,١٦	-٠,٨٤	-١,٣٩	٧,٥٥	-١١,٨٥	

يمكننا الملاحظة أن هناك تغييراً طفيفاً لهذه التقديرات مقارنة مع التقدير السابق، وذلك يعود إلى سببين اثنين:

- إدخال ظاهرة "SALON" التى تعدل تقديرات المعاملات للمتغيرات الأخرى.
- الزيادة فى حجم المشاهدات (إضافة سنتين).

(١) هناك مجموعة من المعارض تم اختبارها (مثل معرض Bourget للطيران ومعرض السيارات ومعرض باريس، ....) ولم يؤد أى منها إلى تغيرات فى أعداد زوار برج إيفل باستثناء المعرض الزراعى. فأهالى الضاحية الباريسية يأتون إلى باريس للمعرض الزراعى، وفى الوقت نفسه يزورون البرج.

يتم تفسير النموذج المقدر السابق على النحو التالي:

**SALON** = معرض الزراعة (متغير ثنائى التصنيف) وخلال فترة المعرض يزداد عدد زوار برج إيفل بمقدار (١٢.١٦٪). وهذا المتغير هو المتغير التفسيري الوحيد المتعلق بالمعارض والذي يبدو معنوياً وذا دلالة إحصائية.

**PRECIPAPM** = كميات المطر الهائلة لفترة بعد الظهر، حيث يؤدي هطول واحد ميليمتر من المطر إلى انخفاض قدره (٠.٨٤٪) من عدد الزوار.

**PRECIPMA** = كميات المطر للفترة الصباحية، حيث يؤدي هطول واحد ميليمتر من المطر إلى انخفاض قدره (١.٣٩٪) من عدد الزوار.

**TYPJOUR** = يوم عطلة استثنائي يقود إلى زيادة في عدد الزوار بمقدار (٧.٥٥٪).

**NEIGE** = يؤدي يوم الثلج إلى تخفيض (١١.٨٥٪) في عدد الزوار.

**TC** = الحد الثابت وهو يقيس متوسط عدد الزيارات اليومية إذا استثنينا الظواهر الفصلية والعوامل الخارجية ويساوى إلى (١٤٨٢٧) زائراً.

## ٢-٣-٣- نزع التأثيرات الخارجية:

من خلال معرفتنا للحوادث الخارجية التي أثرت في أعداد الزوار للعام ١٩٩٥م، يمكننا من خلال المعاملات المحسوبة نزع هذه التأثيرات وإعادة حساب معامل الاختلاف (الجدول رقم ٦) بعد التخلص من التأثيرات الداخلية (المركبات الفصلية) والخارجية.

الجدول رقم (٦) معامل الاختلاف للسلسلة الخام، للسلسلة المصححة يومياً وأسبوعياً

وللسلسلة المصححة من التقلبات الخارجية

السلسلة الخام	السلسلة المصححة من التقلبات الفصلية (الجدول ٢)	السلسلة المصححة من التقلبات الفصلية والعوامل الخارجية	
١٤٤٧٨	١٤١٣٧	١٤٦٧٨	المتوسط
٦٧٤٦	٣٠٦١	٢٤٣٨	الانحراف المعياري
٠.٤٧	٠.٢٢	٠.١٧	معامل الاختلاف

نلاحظ انخفاضاً جديداً لمعامل الاختلاف، فقد تغيرت قيمته من (٠.٢٢) إلى (٠.١٧). بعد هذه الخطوة ننتقل إلى الخطوة الأهم وهي التنبؤ.

## ٢-٤- التنبؤ بواسطة نموذج Holt للصقل:

بعد تصفية السلسلة الزمنية من التأثيرات الفصلية والخارجية نجرى الآن عملية تمديد خارجي لهذه السلسلة باستخدامنا لإحدى تقنيات الصقل (الفصل الثالث) مما يسمح بإدخال ظواهر الاتجاه العام على المدى القصير والمتوسط.

يتم إجراء التنبؤ على السلسلة اليومية المخلصة من الظواهر الفصلية ومن المتغيرات الخارجية ذات الصلة. ولقد تم إجراء نوعين منفصلين من الصقل:

- الصقل للمتوسط باستخدام معامل صقل  $a$  حيث  $a \in [0,1]$ .
- الصقل لمركبة الاتجاه العام باستخدام معامل صقل  $\beta$  حيث  $\beta \in [0,1]$ .

العلاقات المستخدمة:

$$F_t = a x_t + (1-a) (F_{t-1} + T_{t-1})$$

$$T_t = \beta (F_t + F_{t-1}) + (1-\beta) T_{t-1}$$

ويكون التنبؤ المحسوب في اللحظة  $t$  للمجال الزمني  $h$  فترة على النحو التالي:

$$\hat{x}_{t+h} = F_t + h T_t / \sqrt{h}$$

حيث:

$x_t$ : القيمة المشاهدة للسلسلة في اليوم  $t$ .

$F_t$ : المتوسط الصقل للسلسلة في اليوم  $t$ .

$T_t$ : مركبة الاتجاه العام المقدرة في اليوم  $t$ .

نجرى عملية تخفيف لحدّة مركبة الاتجاه العام (من خلال الجداء بـ  $\sqrt{h}$  وليس بـ  $h$ ) مع الأخذ بعين الاعتبار لمجال التنبؤ للنموذج البالغ تقريباً (٢٥) يوماً.

إعطاء القيم الابتدائية (من أجل  $t = 1$ ):

- القيمة الابتدائية للمتوسط المصقول:  $F_1 = x_1$

- القيمة الابتدائية لمركبة الاتجاه العام:  $T_1 = 0$

## ٢-٥- محاكاة النموذج وتحليل الانحرافات:

لقد تم إجراء محاكاة لنموذج التنبؤ لفترة ثلاث سنوات من خلال إضافة المكونات الأساسية للتنبؤ:

التنبؤ بأعداد الزوار = الصقل + الظواهر الخارجية + الفصلية الأسبوعية + الفصلية اليومية.

أدى تحليل الانحرافات حسب المعطيات اليومية البالغة (١٠٩٦) يوماً متضمنة نهاية شهرى تشرين الثانى وكانون الأول لعام ١٩٩٥م إلى النتائج فى (الجدول رقم ٧).

الجدول رقم (٧) محاكاة التنبؤ

الانحراف النسبى	الانحراف المطلق	
١٤	١٦٦١	المتوسط
-٩٩٤١	٢	القيمة الدنيا
١١٢٤٧	١١٢٤٧	القيمة العظمى
% للخطأ	١١,٤٧	

يبين العمود الثانى من الجدول السابق الانحرافات النسبية (يشير المتوسط (١٤) إلى أن الموازنة بين الانحرافات تتم بشكل جيد)، ويظهر من العمود نفسه أن خطأ التنبؤ الأكثر ارتفاعاً هو (١١٢٤٧) والأقل انخفاضاً هو (٩٩٤١) (بإشارة سالبة). وبالطبع فقد تم البحث عن بعض التفسيرات لهذه الانحرافات النسبية. ويعتبر تحليل الانحرافات المطلقة لأخطاء التنبؤ (العمود الثالث) أكثر أهمية من الانحرافات النسبية، فمدى الخطأ المتوسط هو (١٦٦١) مشاهدة (١١,٤٧% من عدد الزوار المتوسط) وخطأ التنبؤ الأصغر بالنسبة لأى يوم هو مشاهدتان، فى حين نحصل على قيمة خطأ التنبؤ الأكبر نفسه. نتوقع إذن دقة فى التنبؤ بعدد الزوار تعادل (١١,٥%).

## ٢-٦- التنبؤ لشهر حزيران عام ١٩٩٦م:

تم إجراء التنبؤ لشهر حزيران من عام ١٩٩٦م باستخدام المكونات السابق شرحها أى: التنبؤ بأعداد الزوار = الصقل + الظواهر الخارجية + الفصلية الأسبوعية + الفصلية اليومية.

ويجب الإشارة إلى أنه بالنسبة للمتغيرات الخارجية قد تم الأخذ بعين الاعتبار لتغيري «أيام العطل» و«معرض الزراعة» فقط، وإهمال المتغيرات المتعلقة بحالة الطقس لعدم إمكانية التنبؤ بالتغيرات المناخية لهذه الفترة، أي إننا نفترض عدم وجود مطر أو ثلج.

ولقد تم حساب مجال للتنبؤ ( $PREV+$  و  $PREV-$ ) بدلالة النتائج السابقة، ومن ثم فإن القيم المتنبأ بها يجب أن تقع ضمن حدى مجال التنبؤ.

نلاحظ من خلال الجدول رقم (٨) ومن خلال الشكل البياني رقم (٣) وجود فعالية جيدة لنموذج التنبؤ. حيث يتضح وجود عدد محدود جداً من الأيام الثلاثين يكون فيه الخطأ النسبى للتنبؤ أكبر من (١١.٥٪). كما أن الخطأ النسبى المتوسط لهذه الفترة يبلغ (٦.٦٪)، وهذه القيم يجب مقارنتها مع قيمة معامل الاختلاف للمعطيات الخام والبالغة (٤٧٪).

الجدول رقم (٨) التنبؤ لشهر حزيران عام ١٩٩٦

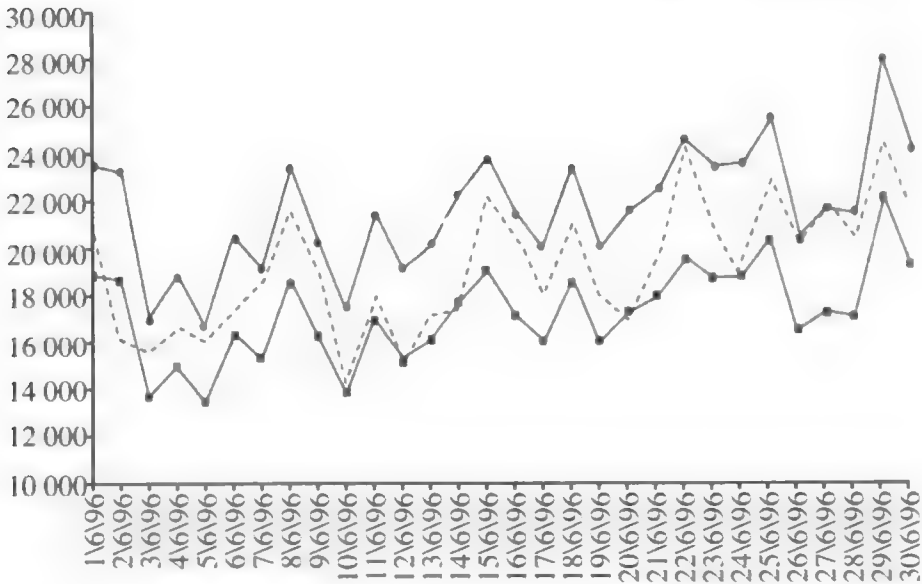
التاريخ	التنبؤ	$PREV+$	$PREV-$	الفعلى ٩٦/٠٦	الانحراف %
٩٦/٦/١	٢١١٥٧	٢٣٥١١	١٨٨٠٣	٢٠٩٢٥	١.١
٩٦/٦/٢	٢٠٩٢١	٢٣٢٤٨	١٨٥٩٣	١٦١٠١	٢٣
٩٦/٦/٣	١٥٢٩٥	١٥٢٩٥	١٦٩٩٧	١٣٥٩٣	١.٣-
٩٦/٦/٤	١٦٩١٢	١٦٩١٢	١٨٧٩٤	١٥٠٣١	١.٦
٩٦/٦/٥	١٤٩٨٧	١٤٩٨٧	١٦٦٥٥	١٣٣٢٠	٧.١-
٩٦/٦/٦	١٨٤٤٩	١٨٤٤٩	٢٠٥٠٢	١٦٣٩٦	٥.٨
٩٦/٦/٧	١٧١٤٥	١٧١٤٥	١٩٠٥٣	١٥٢٣٧	٨.٧-
٩٦/٦/٨	٢٠٩٥٦	٢٠٩٥٦	٢٣٢٨٨	١٨٦٢٤	٣.٨-
٩٦/٦/٩	١٨٢٨٨	١٨٢٨٨	٢٠٣٢٣	١٦٢٥٣	٥.٠-
٩٦/٦/١٠	١٥٦٥٨	١٥٦٥٨	١٧٤٠٠	١٣٩١٦	٩.٠-

تابع - الجدول رقم (٨).

التاريخ	التنبؤ	+PREV	-PREV	الفعلى ٩٦/٠٦	% الانحراف
٩٦/٦/١١	١٩٢٩١	٢١٤٣٨	١٧١٤٥	١٨١٣٧	٦.٠
٩٦/٦/١٢	١٧٢٦٨	١٩١٨٩	١٥٣٤٦	١٤٩٥٩	١٣.٤
٩٦/٦/١٣	١٨١٩١	٢٠٢١٦	١٦١٦٧	١٧٢٩٧	٤.٩
٩٦/٦/١٤	٢٠٠٢٠	٢٢٣٤٨	١٧٧٩٢	١٧٤٣٦	١٢.٩
٩٦/٦/١٥	٢١٥٢٦	٢٣٩٢١	١٩١٣١	٢٢٣١٧	٣.٧-
٩٦/٦/١٦	١٩٢٩٧	٢١٤٤٤	١٧١٥٠	٢٠٦٧٦	٧.١-
٩٦/٦/١٧	١٨١٠١	٢٠١١٥	١٦٠٨٧	١٨١١٠	٠.١-
٩٦/٦/١٨	٢١٠٧٩	٢٣٤٢٤	١٨٧٣٣	٢١٢٣٢	٠.٧-
٩٦/٦/١٩	١٨٠٦٣	٢٠٠٧٢	١٦٠٥٣	١٨٠١٦	٠.٣
٩٦/٦/٢٠	١٩٥٣٧	٢١٧٠٠	١٧٣٥٥	١٧٠٠٢	١٢.٩
٩٦/٦/٢١	٢٠٣٢٩	٢٢٥٩١	١٨٠٦٧	١٩٤١٦	٤.٥
٩٦/٦/٢٢	٢٢١٢٥	٢٤٥٨٧	١٩٦٦٣	٢٤٧١١	١١.٧-
٩٦/٦/٢٣	٢١٢٢٤	٢٣٥٨٥	١٨٨٦٢	٢١٠١١	١.٠
٩٦/٦/٢٤	٢١٣٥٨	٢٣٧٣٥	١٨٩٨٢	١٨٨٢٨	١١.٨
٩٦/٦/٢٥	٢٣٠٦٧	٢٥٦٣٣	٢٠٥٠٠	٢٣١٦٩	٠.٤-
٩٦/٦/٢٦	١٨٦٨١	٢٠٧٥٩	١٦٦٠٢	٢٠٤٠٢	٩.٢-
٩٦/٦/٢٧	١٩٥٦٣	٢١٧٤٠	١٧٣٨٦	٢٢١١٣	١٣.٠-
٩٦/٦/٢٨	١٩٥٠٩	٢١٦٨٠	١٧٣٣٩	٢٠٧٢٨	٦.٢-
٩٦/٦/٢٩	٢٥٢٩٢	٢٨١٠٦	٢٢٤٧٨	٢٤٧٧٩	٢.٠
٩٦/٦/٣٠	٢١٩٣٣	٢٤٣٧٤	١٩٤٩٣	٢١٩٤٣	٠.٠



الشكل البياني رقم (٣) التنبؤ لشهر حزيران ١٩٩٦



(الخط المنقط بين مجالي التنبؤ الأعلى +PREV والأصفر -PREV يمثل القيم المحققة فعلاً لشهر حزيران لعام ١٩٩٦م)

يمكننا من خلال أدوات حساب بسيطة وباستخدام البرنامج إكسل وضع طريقة كاملة للتنبؤ تأخذ بعين الاعتبار الظواهر الداخلية والخارجية التي سبق شرحها. ويمكن بالطبع تحسين هذه الطريقة لكي تعطى تنبؤات على مستويات أدق من السابقة. أي على مستوى أنصاف النهار أو حتى الساعية. ولكن لا بد من الأخذ بعين الاعتبار أن هذه الطرائق تستند إلى فرضية الاستقلالية بين العناصر أو العوامل الفصلية (أسبوعي ويومي) وهذا ليس محققاً دائماً.

### ٣- التنبؤ للمنتجات ذات فترة الحياة القصيرة والمحددة:

#### ٣-١- عرض المسألة:

هناك بعض المنتجات تتميز فترة حياتها بكونها قصيرة جداً (بضعة أشهر) ومثالها منتجات القطاع النسيجي حيث يتم تصميم الأزياء وتوزيعها لفصل محدد من السنة وتسمى هذه السلع «سلع فصلية».

يمكن للمواصفات المتعددة الخاصة بالمنتجات النسيجية أن تفسر إلى حد ما أرقام المبيعات، أى إن ردود الفعل الإيجابية أو السلبية للمستهلكين على العرض من هذه المنتجات يرتبط بخصائص هذا المنتج كاللون والرسم أو التصميم، وكذلك السعر.

هناك العديد من المشاكل المتعلقة بالتنبؤ لمثل هذا النوع من السلع:

- عدم وجود سلسلة زمنية للمبيعات، ومن ثم عدم إمكانية اللجوء إلى الطرائق التقليدية للتنبؤ (الداخلية والخارجية).
- يجب أن يكون التنبؤ بالطلبات لإجمالي الفصل محسوباً قبل ستة أشهر كي تستطيع المشاغل تأمين الكمية الأمثل، فالتقديرات الأقل من الصحيح تقود إلى انقطاعات فى المخزون، ومن ثم خسارة فى المبيعات، والتنبؤات الأكثر من المطلوب تؤدي إلى وجود مخزون إضافي يتوجب بيعه بأسعار مخفضة فى نهاية الموسم.
- خلال الموسم تؤدي عملية التنبؤ بتشكيلات الألوان والموديلات إلى الملاحظات السابقة نفسها.

يضاف إلى الصعوبات السابقة مسألة ترتبط بقطاع النسيج وهى التوعية فى السلع من حيث نوع السلعة النسيجية واللون والقياس. ومن ثم سيكون التنبؤ متنوعاً لكل لون وللمشتريات حسب القياس.

### ٣-٢- طريقة المعالجة:

سنستعرض هنا طريقتين: واحدة تستند إلى مقاييس الحس أو الإدراك (تحليل المقاييس المتصلة بالمعطيات الصادرة عن المستهلكين المحتملين أى بمنظور ذاتي منذ البداية)، والثانية تستند إلى السلاسل الزمنية للمبيعات وللطلبات (معطيات موضوعية منذ البداية). ويتم التمييز بين هاتين الطريقتين من خلال مجال تطبيقهما:

- فالطريقة الأولى تطبق على تعريف المنتج الجديد الأمثل حسب توفيق خصائصه بالمقارنة مع تفضيلات المستهلكين قبل طرحه فى السوق، ويمكن أن تستخدم فى مجال التنبؤ. وبسبب تكاليفها المرتفعة، فإن هذه الطريقة لا يمكن تنفيذها إلا من أجل المنتجات التى تمثل رقم مبيعات مهم.

- تهدف الطريقة الثانية إلى إجراء تمديد خارجي لسلسلة المبيعات من السلع النسيجية التى تقرر طرحها فى السوق انطلاقاً من مجموعة محددة من الطلبات للأسابيع الأولى. والهدف هو تصحيح الإنتاج مبكراً بحيث يكون المخزون من السلع غير

المباعة فى حدوده الدنيا فى نهاية فترة موسم المبيعات. ويمكن لهذه الطريقة أن تطبق وبشكل سهل على السلع لكل نوع ولكل لون ... إلخ. يلاحظ أن إحدى الطريقتين نوعية والأخرى كمية ولكن غالباً ما تكمل إحداها الأخرى.

### ٣-٣- طريقة الكشف عن التوفيق الأمثل لخصائص المنتج:

تعتمد هذه الطريقة على بعض الوسائل المستخدمة فى مجال التسويق النوعى Marketing qualitatif ويمكن الاستفادة منها على سبيل المثال عند اختبار المنتجات الجديدة.

تنتمى هذه التقنيات إلى ما يسمى «عائلة تحليل المعايير المتوافقة»<sup>(١)</sup> كون الهدف منها هو تحديد المعايير (أو الخصائص) التى يتميز بها منتج ما بالنسبة للمستهلك، وتؤدى بعد ذلك إلى وجود توفيق ما من هذه المعايير يقود إلى الوصول إلى الخيار الأمثل (أى المنتج الأكثر ملاءمة لأذواق المستهلك).

أحد هذه النماذج الأكثر استخداماً فى هذا المجال هو نموذج Trade-Off<sup>(٢)</sup>. ويتكون من الخطوات التالية:

- الطلب وبشكل حر من عينة مكونة من قرابة عشرين مستهلكاً تبين الخصائص المرغوب فيها فى المنتجات.
- إنشاء عينة من المستهلكين أكبر بكثير من السابقة (١٥٠ إلى ٣٠٠) وتكون ممثلة لإجمالى المجتمع المراد، ونطلب منهم التعبير عن خياراتهم حول المنتجات التى تمثل عدة توفيقات من الخصائص.
- بعد ذلك يتم تحويل تفضيلات الأفراد إلى أرقام تشير إلى المنفعة، مما يسمح بتقييم نوعى للمنفعة التى يوليهها المستهلكون لهذه الخاصة أو تلك (على سبيل المثال، السعر والسرعة القصوى وعدد المقاعد لسيارة ما). يتم إذن حساب أرقام المنفعة المتوسطة لإجمالى العينة ولعدة مستويات من الخصائص، وكذلك يتم حساب معاملات التفضيل أو المحابة (أى القدرة لخاصة ما فى أن تكون عنصراً محدداً فى الخيار بشكل مستقل عن العناصر الأخرى). ومن ثم يمكننا إذن تصنيف خصائص المنتج حسب أهميتها.

(١) بهذا المعنى العام هناك العديد من الطرائق والبرمجيات، ويمكن للقارئ المهتم العودة إلى (Green, Tull et Albaum 1988) الفصل (١٥).

(٢) لقد تم اقتراح هذه النموذج من قبل (Johnson 1974) ثم تم تبنيه فى فرنسا من قبل (Faivre et Schwoerer 1975). نحن نعتمد فى هذا العرض على (Maricourt 1985).

يمكن أيضاً حساب أرقام المنفعة ومعاملات التفضيل لأجزاء أخرى من السوق ممثلة لعينات جزئية من العينة الكلية. فانطلاقاً من تفضيلات هذه المجموعات من المستهلكين المحتملين يمكننا تقدير توزيع المبيعات حسب شرائح الزبائن.

يتم إجراء التنبؤ إذن عبر عملية محاكاة simulation. نقارن أولاً حصص السوق الموافقة لمختلف التوفيقات من خصائص المنتج وبشكل خاص التوفيق الموجود (المنتج بوضعه الحالي). وهذه الحصص يتم حسابها على أساس نتائج حسابات المنفعة. بعد ذلك نجرى محاكاة (تمثيل) لأوضاع السوق الناتجة إما من تعديل لخاصة محددة من قبل المنشأة، أو من قبل أحد المنافسين لهذه المنشأة، أو بسبب طرح منتج جديد مكمل في السوق شريطة أن تكون له الخصائص نفسها.

لهذه الطريقة بعض القيود:

- تكلفة استخدامها مرتفعة.
- بياناتها الأساسية محدودة وذات طابع شخصي وحساسة جداً لمحتوى العينة ولآلية اختيار طريقة جمع بيانات الأفراد فيما يتعلق بالمعايير حول خصائص المنتج.
- تمكن من وجود علاقة مباشرة بين نتائج المنفعة وحصة السوق، وتتجاهل دور المتغيرات الأخرى (التوزيع على سبيل المثال) الذي يمكن أن يشوش هذه العلاقة<sup>(١)</sup>.

### ٣-٤- الطريقة التفسيرية بواسطة تجميع الطلبيات:

تستند هذه الطريقة إلى مفهوم منحى حياة المنتج وتأخذ بعين الاعتبار التراكمات من الطلبيات المسجلة على المنتج وحالة تقدم جولة مندوبى المبيعات كعامل تفسيري.

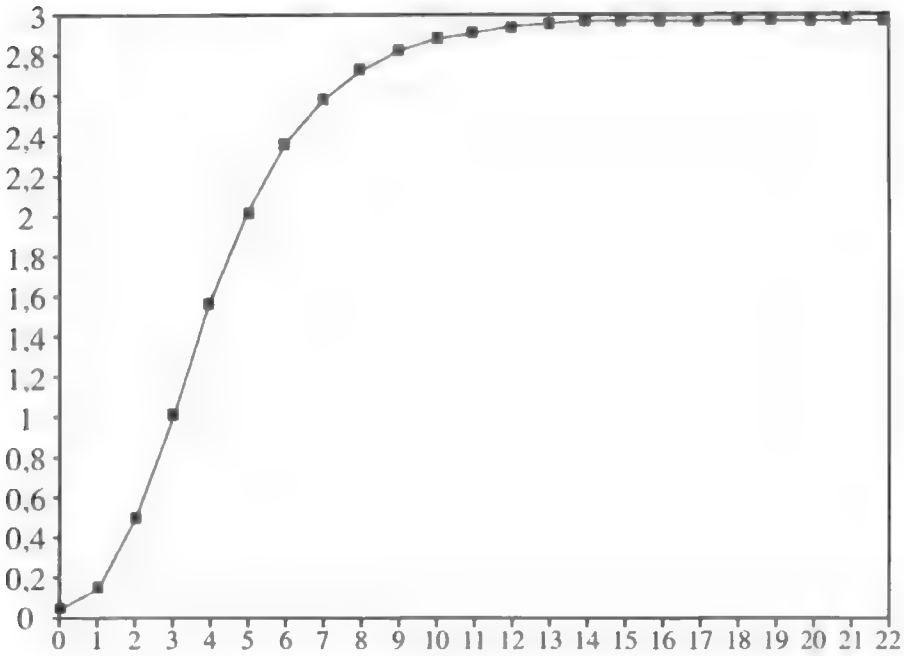
- تجميع الطلبيات والأخذ بعين الاعتبار للمبيعات المحتملة:

عند طرح منتج جديد من الألبسة في السوق يبدأ مندوبو المبيعات بالبحث عن الطلبيات لهذا المنتج ويتم تجميعها شيئاً فشيئاً مع تقدم جولاتهم على المناطق. يأخذ شكل منحى تجميع الطلبيات خلال الموسم (الطلبيات لموديلات الصيف يتم تجميعها في فصل الشتاء) شكلاً مختلفاً وفقاً لآلية تنظيم جولة مندوبى المبيعات:

(١) شرح هذه الطريقة لا يشكل هدفاً في هذا الكتاب، وإنما تعمداً عرضها لكي تكون متاحة لمن يرغب من القراء والاستفادة من المراجع الملحق ذات الصلة.

- فإذا بدأ هؤلاء المندوبون بالزيائن الأكثر أهمية أى الأكثر احتمالاً للبيع (حيث يتم تقدير قدرة هؤلاء على الشراء من خلال أرقام الموسم السابق) يكون لمنحنى تجميع الطلبات الشكل المعروض فى الرسم البيانى رقم (٤). يمكننا القول عندئذ أن المعطيات الأولى عن تسجيل الطلبات تمثل المبيعات الإجمالية التى يفترض تحقيقها خلال الموسم.

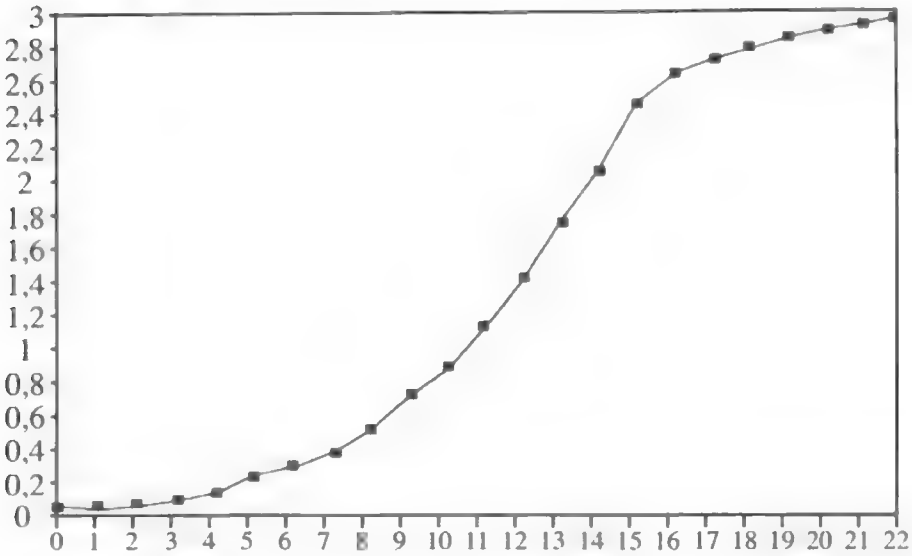
الشكل البيانى رقم (٤) تجميع الطلبات خلال الموسم: زيارة الزبائن المهمين أولاً



(فى الشكل البيانى رقم (٤) السابق تم تمثيل الأسابيع على المحور الأفقى والمبيعات التراكمية بالآلاف على المحور العمودى.)

- بالمقابل إذا بدأ مندوبو المبيعات بالزيائن الأقل أهمية سيكون لتراكم المبيعات خلال الموسم الشكل المعروض فى الرسم البيانى رقم (٥). وتكون حركة تسجيل الطلبات، رغم تكافئها بالمطلق مع الحالة السابقة، أقل تمثيلاً لحركة المبيعات الإجمالية كونها مرتبطة بحجم ضئيل من هذه المبيعات خلال الفترة الإجمالية.

الشكل البياني رقم (٥) تجميع الطلبيات خلال الموسم: زيارة الزبائن الأقل أهمية أولاً



(في الشكل البياني رقم (٥) السابق تم تمثيل الأسابيع على المحور الأفقي والمبيعات التراكمية بالآلاف على المحور العمودي.)

يمكننا من أجل التنبؤ محاولة إجراء عملية تمديد خارجي لهذه المعطيات المتعلقة بتسجيل الطلبيات الأولى خلال كل الأسابيع الأولية عبر توفيقها بواسطة المنحنى المنطقي<sup>(١)</sup>. ولكن في حال كان للتمثيل البياني الشكل المعروف بالحرف "S" عند اعتبار درجة الإشباع من المنتج، فإن تطبيق المنحنى المنطقي يكون مستحيلاً هنا. ففي الواقع المعطيات هنا (أي تراكم الطلبيات) منسوبة إلى الأهمية (حسب المبيعات المحتملة) التي يوليها الزبائن المزورين (أي تبعاً لاحتمالية البيع)، ومن ثم فإن المسار الزمني لتسجيل الطلبيات التراكمية الأسبوعية يتضمن مجاميع لا يمكن مقارنتها بشكل مباشر. ولذلك لا يمكن استخدام النماذج الرياضية الخاصة بالسلاسل الزمنية<sup>(٢)</sup>.

(١) الفصل السابع.

(٢) يتم التمييز بين فئتين كبيرتين من العينات:

- تلك المستخدمة في السلاسل الزمنية وهي عبارة عن مجموعة من القيم مؤشرة زمنياً.
- تلك المعروضة على شكل معطيات مقطعية حيث تمثل البيانات القيم الملاحظة لفترة واحدة من الزمن. أي التاريخ نفسه، ومثالها المعطيات لمجموعة من البلدان أو من المنشآت عند تاريخ محدد.

## - المقارنة مع الاتجاه العام:

نسعى هنا إلى مقارنة تراكم الطلبات للفصل الحالى لسلعة ما مع تراكم الطلبات المسجلة فى الموسم الماضى للمجموعة التى تنتمى إليها السلعة المدروسة.

لنأخذ المثال التمهيدى التالى: إذا افترضنا أن تراكم الطلبات فى الأسبوع السادس لسلعة ما ولتكن بلوزة نسائية صيفية هو (٣٠٠٠٠) قطعة، وأنه فى العام المنصرم كان التراكم فى الطلبات لمجموعة القمصان الصيفية فى الأسبوع نفسه أى السادس هو (٤٢٠٠٠٠٠) قطعة، وتم بيع ما مجمله (٩٢٠٠٠٠) قطعة. نستخلص من ذلك أن المبيعات الإجمالية للموسم الجارى من القمصان النسائية الصيفية سيرتفع إلى:  $(٣٠٠٠٠ \times ٩٢٠٠٠٠ / ٤٢٠٠٠٠ = ٦٥٧١٤ \text{ قطعة})$ .

تستند هذه الطريقة فى التنبؤ إلى مبدأ التماثل (حيث تم استخدام القاعدة الرباعية: الطرفين بالوسطين).

لنعرف الآن هذه العلاقة باستخدام المعطيات المقطعية (أى النموذج الذى يعرض كل المتغيرات بتاريخ زمنى واحد) وباستخدام عنصرين تفسيريين هما:

- الحصص المقدرة من المبيعات التى تم الحصول عليها عبر زيارات مندوبى المبيعات (و يتم التعبير عن هذه الحصص بالنسبة ما بين إجمالى الزبائن الذين تمت زيارتهم إلى رقم المبيعات الإجمالى للمنشأة أو لمجموعة المنتجات).

- تراكم الطلبات (أى السلسلة الأسبوعية الممتلئة لتراكم الطلبات منذ طرح المنتج فى السوق).

يكتب النموذج العام على النحو التالى:

$$VT = a_0 \times PPV^{a_1} \times PC^{a_2}$$

أو على الشكل اللوغاريتمى التالى:

$$\text{Log } VT = \text{Log } a_0 + a_1 \text{ Log } PPV + a_2 \text{ Log } PC$$

حيث:

$VT$  = المبيعات الإجمالية خلال الموسم لمجموعة ما من السلع.

$PPV$  = الحصص المحتملة من البيع والمقدرة من خلال زيارات المندوبين للمجموعة نفسها من السلع.

$PC$  = تراكم الطلبات لهذه المجموعة.

وبما أن البيانات ممثلة بعينة من المعطيات المقطعية، فإنه يكون مقابل المبيعات من كل أسبوع لسلعة ما، الطلبات المسجلة لمجموعة السلع التي تنتمي إليها السلعة المباعة.

تمثل القيم  $a_0, a_1, a_2$  معاملات التثقيل لكل متغير تفسيري ويعبر عنها باستخدام مفهوم المرونة:

-  $a_1$ : مرونة المبيعات الإجمالية للزبائن المزارين.

-  $a_2$ : مرونة المبيعات الإجمالية للطلبات المسجلة.

- استخدام النماذج الأسبوعية:

ليس هناك من نموذج وحيد وإنما هناك عدد من النماذج مساوٍ لعدد أسابيع الجولات التي يقوم بها مندوبو المبيعات (تقريباً نحو ٢٠). ومن ثم لا بد من الأخذ بعين الاعتبار للمعلومات الواردة شيئاً فشيئاً، والتي تزداد دقتها تبعاً لحالة التقدم في الجولات الميدانية لمندوبي المبيعات.

يكتب النموذج من أجل الأسبوع  $i$  على النحو التالي:

$$\text{Log } VT_i = \text{Log } a_{0,i} + a_{1,i} \text{Log } PPV_i + a_{2,i} \text{Log } PC_i$$

حيث:

$VT_i$  = المبيعات الإجمالية خلال الموسم والمقدرة للأسبوع  $i$ .

$PPV_i$  = حصة المحتمل من البيع خلال زيارة المندوبين في الأسبوع  $i$ .

$PC_i$  = تراكم الطلبات في الأسبوع  $i$ .

تمثل القيم  $a_{0,i}, a_{1,i}, a_{2,i}$  معاملات الانحدار المقدرة بواسطة المبيعات المحققة بشكل أسبوعي لفئة المنتجات في العام الماضي.

تتخفض قيمة المعامل  $a_{1,i}$  إلى القيمة صفر كلما تم التقدم في جولة المندوبين، في حين تزداد قيمة المعامل  $a_{2,i}$  نحو القيمة (١) في نهاية الجولة الميدانية للمندوبين حيث يكونون قد أتموا زيارة كل الزبائن المحتملين.

- الاستخدام التنبؤي:

انطلاقاً من المعلومات الواردة أسبوعياً من قبل المندوبين (غالباً بواسطة وسيلة آلية مثل جهاز حاسب محمول) يكون ممكناً تقدير المبيعات الإجمالية للموسم لكل سلعة، بدقة تتزايد أسبوعاً بعد أسبوع. يكفي بعد ذلك إدراج المعطيات الجديدة حول



الطلبات المسجلة (ومن ثم رقماً تراكمياً جديداً) وكذلك المتوقع من البيع عبر الزيارات للسنة وللأسبوع الجارى فى النموذج المقدر انطلاقاً من الموسم الماضى.

يمكن إجراء التنبؤ على مستوى السلع، أو على مستوى ألوان السلع، ولكن نادراً ما يكون على مستوى القياس نظراً لكبر الحجم.

#### - طريقة تقدير المعاملات:

يتم تقدير المعاملات عادة على مستوى مجموعة المنتجات المتجانسة مما يؤدي إلى استخدام النموذج نفسه لكل السلع التى تنتمى إلى المجموعة المدروسة.

يتم إجراء التقدير باستخدام الانحدار المتعدد المطبق بشكل متتابع للأسابيع العشرين المكونة للموسم مما يعطى مصفوفة مكونة من  $20 \times 2$  معاملاً للنموذج (٢٠ أسبوعاً  $a_0, a_1, a_2$ ):

$$\log VT_i = \log a_{0,i} + a_{1,i} \log PPV_i + a_{2,i} \log PC_i \quad \text{من أجل } i = 1, 20$$

من المناسب تكوين (٢٠) عينة مكونة من  $n$  سلعة منتقاة من مجموعة منتجات محددة ( $n > 30$ ):

- سلسلة المتغير الواجب تفسيره (VT) أى المبيعات الإجمالية من السلعة  $j$  للموسم،  $j = 1, n$ .
- السلسلة التفسيرية الأولى (PPV) أى الحصة المتوقعة من المبيعات للزيارة فى الأسبوع  $i$ .
- السلسلة التفسيرية الثانية (PC) أى الطلبات المتراكمة فى الأسبوع  $i$  للسلعة  $j$ .

وهكذا فإن النتائج العشرين للانحدار تعطى تقديراً لـ (٢٠) معلمة تكون فيما بعد مستخدمة فى الموسم التالى.

لكى تكون هذه الطريقة فى التنبؤ فعالة لا بد من توخى الحذر فى تطبيقها. فكل معامل من معاملات النموذج يناسب أسبوعاً محدداً، ومن ثم لا بد من الانتباه إلى التوافق بين مختلف معاملات الانحدار والحالة الفعلية لتقدم الجولة الميدانية للمندوبين. وأى اختلاف سيقود إلى نتائج متحيزة.

### ٤- المخطط العام للتنبؤ فى قطاع الألبسة النسيجية:

#### ٤-١- خصائص القطاع:

- يمكننا التمييز بين ثلاثة أنماط من المنتجات النسيجية حسب خصائصها المختلفة:
- السلع النسيجية الدائمة Permanents التى لها نموذج أزىاء واحد لكل العام وكثير من الاختلافات بين الموديلات المكونة لهذا النموذج.

- السلع النسيجية غير المألوفة Fantaisies (أو سلع الموضة أو الموسمية أو الأزياء) التى تتميز بوجود نموذجين من الأزياء أو أكثر فى السنة الواحدة أو حتى وجود عملية تصميم مستمرة لهذا النوع من الأزياء. كما تتميز بقليل من الاختلافات بين الموديلات المكونة لنموذج الأزياء الواحد.

- السلع النسيجية الخاصة بماركة مصمّم أو مؤرّع ما ومخصصة لمحل محدد ولموسم معين. وتتصف بطريقة تفصيل وحيدة ومميزة.

أما عملية التوزيع لهذه المنتجات النسيجية فهى تتم عبر أربع قنوات:

- متاجر تقليدية للبيع بالمفرق.
- فى المحلات التجارية الكبرى (BHV، Galerie Lafayette، .....).
- سلسلة محلات البيع بالمفرق المستقلة ولماركات معينة (Lacoste).
- فى المخازن التجارية الكبرى (Carrefour، Géant، ...).

#### ٤-٢- طريقة التنبؤ:

هناك طريقتان للتنبؤ تتعلقان بالسلع النسيجية الدائمة وبيع الأزياء:

فبالنسبة للسلع الدائمة، يكون لنظام التنبؤ المتبع الخصائص الأساسية التالية:

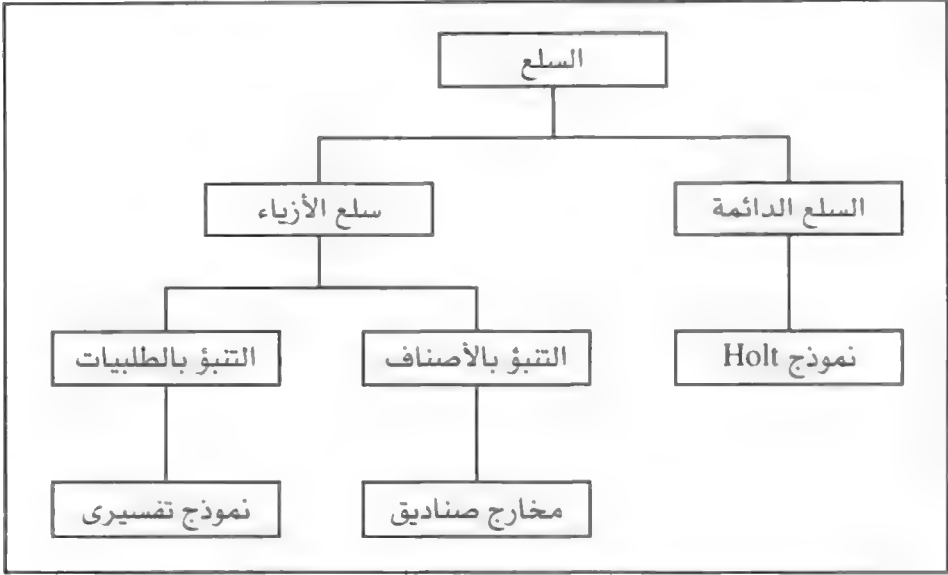
- نظام شهرى لتحديث التنبؤ.
- مجال التنبؤ يمتد إلى (١٢) شهراً.
- طريقة حساب من نمط الصقل الآسى.
- تطبيق الطريقة حسب الموديل واللون ووفقاً للتأثير الموسمى.

أما بالنسبة لسلع الأزياء، فهناك ثلاثة طرائق لإجراء التنبؤ، وهى تتعلق بكل مرحلة من مراحل دورة حياة المنتج:

- قبل طرحه فى السوق، يتم الاستعانة بتقديرات أولية شخصية مستمدة من التشابه بين الصنف الجديد والأصناف السابقة (الفقرة ٢-٣).
- خلال فترة جولة مندوبى المبيعات، يتم الاستعانة بنماذج التجميع المتتالى للطلبات المسجلة من قبل المندوبين (الفقرة ٣-٤).
- خلال فترة البيع فى منافذ التوزيع، يتم التنبؤ بأصناف السلع بواسطة مخارج الصندوق الآلية.

يبين الرسم التوضيحي (١) مخططاً لمشاكل التنبؤ المستخدمة في قطاع السلع النسيجية.

الرسم التوضيحي رقم (١) مخطط توضيحي لمسائل التنبؤ في قطاع السلع النسيجية



---

## الجزء الثالث

### إنشاء وتثبيت نظام التنبؤ

لتثبيت نظام للتنبؤ فى منشأة ما لا بد من مراعاة بعض المراحل التى تشكل فيما بينها حلقات متتالية من سلسلة واحدة. ولكى يكون النظام الناتج فعالاً، يجب التأكد من تثبيت كل حلقة بشكل صحيح وفعال، وتشمل هذه الحلقات ما يلى:

- المعطيات: ما نوع المعطيات الواجب استخدامها؟ كيف يتم جمع المعطيات ومن ثم إدارتها؟

- كيف نراقب جودة التنبؤات؟ وهذا لا يعنى عبر مقارنة الانحرافات عن القيم المحققة فحسب، وإنما مدى ملائمة هذه التنبؤات مع الدقة المرادة من المعطيات المتنبأ بها أيضاً.

- كيف يتم شرح هذا النظام للتنبؤ للأشخاص وللموظفين وبعد ذلك استخدامه.

فى هذا الجزء، سنعالج المواضيع المتعلقة بالمعطيات وبمصادر البيانات الإحصائية وكذلك بمفهوم نظام المعلومات التجارى.

ففى الفصل العاشر سنعالج البدائل المختلفة لتثبيت نظام التنبؤ وكذلك الأشخاص المعنيين بذلك. وسنبحث فى عملية إدخال التنبؤ فى المنشأة من خلال تسليط الضوء على المفاهيم البشرية والتنظيمية.

أخيراً، سيكون الفصل الحادى عشر مخصصاً لإجراءات تقييم أنظمة التنبؤ، ومن ثم اختيار الطريقة المناسبة.



## الفصل العاشر

### تثبيت نظام التنبؤ

تمثل كلمة «تنبؤ» بالنسبة للمنشأة نتيجة مهمة والطرق التي تقود إلى هذه النتيجة متنوعة. فقد يقتصر الأمر على استخدام إحدى البرامج البسيطة لمعالجة البيانات الإحصائية Tableur ومن خلاله يتم الحصول على التنبؤات بالمبيعات، وقد تلجأ المنشأة إلى تصميم أو اعتماد نظام متكامل للتخطيط يبدأ بالتنبؤ بالطلب، وينتهى بمعالجة مثلى للمخزون في المستودعات. ويختلف عدد الأقسام الإسهام في تصميم النظام أو المستخدمة له بشكل كبير تبعاً للأهداف المرجوة من التنبؤ.

نعرض في هذا الفصل في الفقرة (١) كيفية تحليل مسألة تثبيت نظام التنبؤ. وكما أشرنا سابقاً، فإن التنبؤ يمثل مجموعة من العمليات تشكل فيما بينها سلسلة، حلقاتها يجب أن تكون ذات جودة متجانسة. تتعلق الحلقة الأولى بكيفية انتقاء المعطيات ومن ثم تصميم نظام المعلومات، وتحتل المرحلة الثانية موقعاً مركزياً يتمثل بكيفية إيجاد نظام للمعالجة الآلية (عبر الحاسب) لطريقة التنبؤ، وسنعرض في الفقرة (٢) البدائل المتاحة لهذه المعالجة الآلية.

بعد تصميم النظام وتثبيته، لا بد من الاهتمام بتكامل هذا النظام وانسجابه داخل المنشأة وكذلك محاولة الاستفادة من المهتمين بموضوع التنبؤ كل حسب خبرته بحيث يصبح النظام أكثر إفادة. ومسألة تكامل النظام ستكون معالجة في الفقرة (٣).

أخيراً، نعالج في الفقرة (٤) كيفية البحث عن العوامل التفسيرية المستخدمة في نظام التنبؤ وآلية جمع المعلومات الإحصائية.

#### ١- كيفية تحليل مسألة تثبيت نظام التنبؤ:

##### ١-١- تعريف النظام:

نقطة البداية لنظام التنبؤ هي في تحديد أهدافه، ويجب الانطلاق هنا من نمطين للتحليل:

- الأول يتعلق بتحديد الاحتياجات من المعلومات المراد التنبؤ بها.
- والثانى يعالج تكامل نظام الإدارة التنبؤية. حيث توجد عدة إمكانيات، بدءاً بالتنبؤ على اعتباره أداة بسيطة من المعلومات وتساعد في اتخاذ القرارات ووصولاً إلى

الحل التنبؤى الشامل الذى يأخذ بعين الاعتبار مجموعة من المعطيات المتعلقة بإدارة الإنتاج والمخزون وغيرها، وهى التى يتم إدخالها عبر أنظمة آلية مؤتمتة.

إن عملية تكامل نظام التنبؤ تتعلق بمسألتين منفصلتين. درجة الأتمتة المرغوب فيها للعلاقة ما بين نظام التنبؤ وبين الوسائل الأخرى الموجودة للمعالجة الآلية، وكيفية استخدام المعطيات المتنبأ بها عند قياس الانحرافات فيما بعد.

وكما رأينا سابقاً فى الفصل الأول فإن التنبؤ يستند إلى معطيات السوق وليس إلى معطيات المنشأة ويجب أن يؤدي إلى الهدف المحدد لا أن يكون هدفاً بحد ذاته. ولكن بالنسبة للكثير من المنشآت لا تكون الأمور على هذه الحالة، فيتم الخلط ما بين الهدف والتنبؤ وتصبح الانحرافات عن القيم المحققة مشكوكاً فيها من قبل القائمين على المنشأة فى الفترة نفسها من العام السابق. وهنا نطرح السؤال الأساسى التالى: بماذا يخدم أو سيخدم التنبؤ؟

فإذا كانت الإجابة فى هذه المرحلة الأولى من مراحل تثبيت النظام، بأن التنبؤ لا يقدم شيئاً جديداً للمنشأة فمن الأفضل إذن عدم الاستمرار به تقليصاً للنفقات.

ولكن عندما تُعرّف المنشأة بوضوح احتياجاتها من المعلومات المراد التنبؤ بها وكيفية الاستفادة من هذه المعلومات ودمجها فى نظام الإدارة فإن تعريف نظام التنبؤ يتعلق بتلك الاحتياجات مع مراعاة الأخذ بعين الاعتبار بعض القيود المتعلقة بالمعطيات من ناحية توفرها من المنشأة أو من السوق وكذلك الطول الزمنى المطلوب للسلاسل المستخدمة.

### ٢-١-٢- الشراء أو التصميم؟

سؤال مهم يفرض نفسه: هل نشترى نظاماً جاهزاً للتنبؤ أم نصممه بأنفسنا؟ وهنا نعرض وجهتى نظر:

- الأولى لأفراد يمتلكون المعرفة بالقطاع الاقتصادى الذى تنتمى له المنشأة ويعتقدون بوجود قدرات داخل المنشأة قادرة على حل مسألة التنبؤ، إذن هم بالنتيجة يفضلون تصميم النظام لا شراءه.

- الثانية لأفراد يعلمون بوجود تقنيات إحصائية حديثة غير متوافرة فى المنشأة ويعتقدون بأنه من الضرورى اللجوء إلى المختصين فى هذا المجال لإنشاء نظام التنبؤ بعد التحقق من الأعمال السابقة لهؤلاء المختصين فى منشأة أو أكثر من المنشآت التى تنتمى إلى القطاع نفسه.

بشكل عام هناك أرجحية لتبنى وجهة النظر الأولى أى تصميم النظام من قبل المنشأة نفسها، وذلك بالاستناد إلى أمور تتعلق بقيود الميزانية. فالميزانية التى تُقر قبل أشهر من بدء تنفيذها، تبدو صعبة فى توزيع نفقاتها التى تصبح بمعظمها نفقات ثابتة، ومن ثم يصعب التعديل فى توزيع مواردها. ولنتصور منشأة ما رصدت فى ميزانيتها مبلغاً قدره X يورو لتوظيف واستخدام فريق لإدارة التنبؤ. وهذا الأخير ليس لديه أى برنامج جاهز لمعالجة التنبؤ، والميزانية المخصصة لم تأخذ بعين الاعتبار إمكانية شراء البرنامج من الخارج، ومن ثم فإن هذا الموظف سيستخدم فقط الأدوات البسيطة المتاحة فى المنشأة (البرامج البسيطة لمعالجة البيانات) التى - رغم إمكانياتها بالقيام بجميع عمليات الحساب - فإنها لا تتلاءم مع الإدارة «الصناعية»، ومن ثم سيؤدى ذلك إلى خسارة فى الوقت أكبر من تكلفة اقتناء البرنامج الجاهز.

### ١-٣- تشكيل الفريق:

يستلزم تثبيت نظام التنبؤ إشراك عدد كبير نسبياً من الأشخاص (غالباً فى حدود العشرة) وهؤلاء الأشخاص يشغلون وظائف مختلفة داخل المنشأة أو خارجها ويشكلون فريقاً يضم:

- مختصين فى تصميم الأنظمة باعتبارهم مستشارين من خارج المنشأة أو ينتمون إليها.
  - مختصين فى المعالجة الآلية للبيانات.
  - المستخدمين لمعطيات التنبؤ (قوى البيع، قسم التسويق، مسؤول التمويل، ... إلخ).
- إن توزيع المهام بين عناصر فريق التنبؤ يحقق غايتين اثنتين:
- التنظيم بشكل واقعى لعناصر الفريق مما يجنب حصول تعارض فى المهام بين المختصين وغير المختصين.
  - التأكيد على إعطاء مهمة واضحة للمستخدمين تتعلق بتعريف وتطوير النظام.
- ولكى ننجح فى تكوين هذا الفريق يمكننا اتباع التالى:
- انتقاء استشارى متخصص بموضوع التنبؤ.
  - إنشاء فريق تنبؤ من داخل المنشأة يضم:
  - عنصراً من الإدارة العامة.
  - ممثلاً لقسم المعلوماتية.



- الاستشارى المتخصص.

- بعض الأقسام المستخدمة للنظام (التسويق، المبيعات، التمويل، .... إلخ).

- متخصص فى معالجة المعطيات (مسؤول فى نظام المعلوماتية أو مختص فى الإحصاء والدراسات التجارية).

ستكون مهمة هذا الفريق التعريف بنظام التنبؤ بمجمله ومتابعة تطويره واستخدامه العملى.

وتكون مهمة تثبيت النظام الآلى (أدوات الحساب، إدارة قواعد البيانات) على عاتق فريق مكون من اختصاصيٍّ ممثِّل لقسم المعلوماتية. فى حين تكون مهمة تعليم البرنامج للمستفيدين منه على عاتق فريق مكون من استشارى ومن المستخدمين الذين تمت الإشارة إليهم سابقاً.

هذا التنظيم، رغم عدم كونه الوحيد الممكن اتباعه، فإنه يستجيب إلى ضرورة كون اختصاص التنبؤ موزعاً بين الأقسام داخل المنشأة. ومن الضروري تكوين فريق التنبؤ وعدم ترك الأمر لمختص واحد لمراقبة النظام والتحكم به، فمهما كانت إمكانياته وخبراته، فقد يعطى أفضلية لمرحلة ما من مراحل التنبؤ على غيرها من المراحل، كمرحلة إجراء الحساب، ومن ثم يؤثر ذلك فى الجودة الكلية للنظام. بالإضافة إلى ذلك فقد يصبح هذا المختص المناقش الوحيد للمستشار مما يقود إلى تجاهل خبراء السوق ومن ثم إنشاء نظام لا يستجيب إلى احتياجاتهم.

## ٢- الخيارات المتاحة عند تثبيت النظام:

عند التفكير باقتناء نظام التنبؤ، يجب الأخذ بعين الاعتبار النواحي الأساسية التالية:

- بنية المعطيات المعالجة.
- مستوى تطبيق برنامج التنبؤ.
- دورية تحديث التنبؤ.
- المعالجة الآلية للبيانات.
- تنظيم عملية التحقق من النتائج.
- استثمار النتائج.

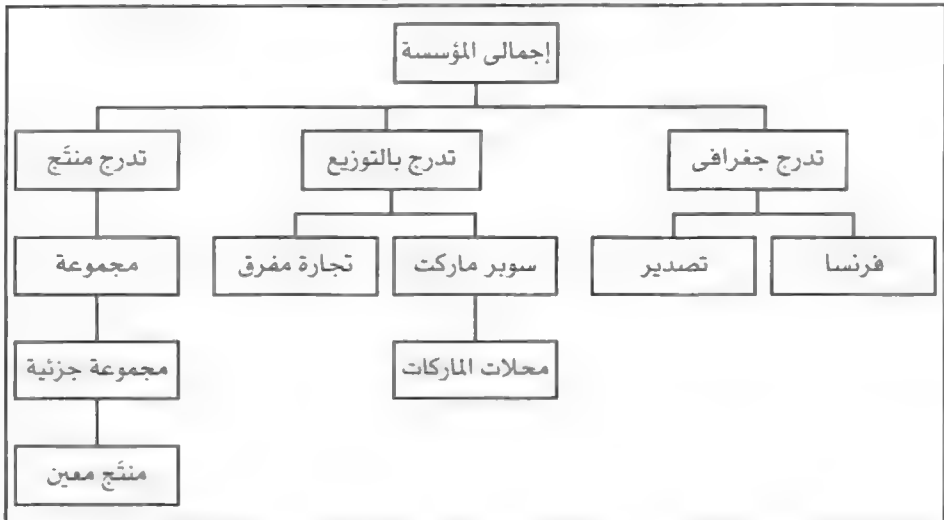
## ٢-١- بنية المعطيات: التدرج:

يتعلق مفهوم تدرج المعطيات بدرجة الدقة للسلاسل الزمنية للمبيعات التي نرغب بإدارتها (تشكيلة منتجات، خط إنتاج، منتج محدد، جزء من السوق، ...). لنأخذ المثال التالي المتعلق بمؤسسة غذائية لها التدرج التالي:

- تدرج في المنتج (مجموعة منتجات، مجموعة جزئية من المنتجات، منتج أو سلعة).
  - تدرج في منافذ التوزيع (محلات بيع المفرق، محلات تجارية متوسطة وكبيرة).
  - تدرج في الحيز الجغرافي للبيع (لفرنسا وللتصدير الخارجى).
- يبين الرسم التوضيحي رقم (١) هذه الهيكلية.

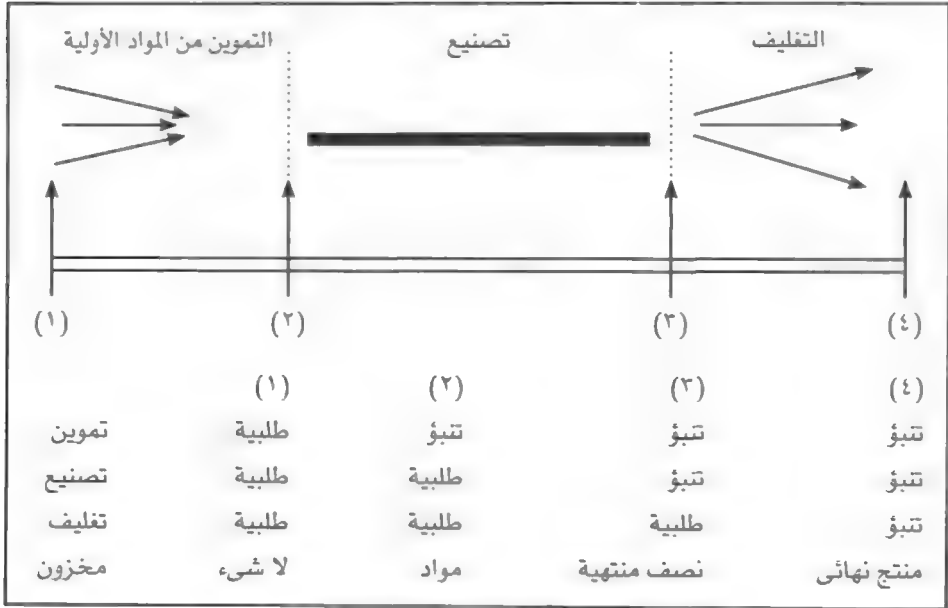
يتم تشكيل هذا النمط من التنظيم حسب «فروع الشجرة» بواسطة سلاسل زمنية مرتبطة فيما بينها بواسطة بعض العلاقات الضمنية. وتكون المجاميع للقيم المتبأ بها لكل سطر من السطور متساوية، وذلك لأننا نجرى فقط عملية توزيع في كل مرحلة. ومن ثم يمكن لبعض السلاسل أن تكون المجموع لسلاسل أخرى ونسميها عندئذ بالسلاسل المركبة (بفتح الكاف) في حين أن تلك المكونة لهذا التجميع فنسميها سلاسل مركبة (بكسر الكاف). ويكون لمعظم السلاسل كلتا الخاصيتين: مركبة ومركبة باستثناء السلاسل المتوضعة على طرفى الشجرة. فالسلسلة «مجموعة» تكون مركبة لأنه من الممكن إعادة تجميعها بمستويات أعلى، في حين أن السلسلة «منتج معين» هي سلسلة مكونة.

الرسم التوضيحي رقم (١) تدرج المعطيات





الرسم التوضيحي رقم (٢) المراحل المختلفة لتكوين المنتج



فإذا كنا في النقطة (١)، فإن زبائن هذه المنشأة يقبلون مدة تسليم لبضائعهم أكبر من الفترة الإجمالية لعملية الإنتاج ككل، ومثال ذلك صناعة الطيران ومن ثم لا يوجد مشكلة للتنبؤ بالمبيعات؛ لأنه سيتم تنفيذ المراحل الثلاث حسب الطلبية.

أما إذا كنا في النقطة (٢)، فإن زبائن هذه المنشأة يقبلون مدة تسليم مساوية لمدة التصنيع والتغليف (مثال ذلك صناعة السيارات)، وهنا يكون التنبؤ بالمبيعات مفيداً لتخطيط عملية التموين من المواد الأولية.

وفي حال توضعنا في النقطة (٣)، فإن زبائن هذه المنشأة يقبلون مدة تسليم مساوية إلى مدة التغليف (مثال ذلك صناعة الحواسيب)، ومن ثم فإن التنبؤ بالمبيعات يتم على المنتجات نصف النهائية ويكون مفيداً لتخطيط عملية التموين من المواد الأولية ومن التصنيع.

أخيراً، إذا كنا في النقطة (٤)، فإن الزبائن سيرغبون في مدة تسليم أقل من إجمالي عملية الإنتاج (مثال ذلك صناعة المنتجات ذات الاستهلاك الكبير) ويستند التنبؤ بالمبيعات إلى المنتج النهائي.

يوضح الجدول رقم (١) عملية التحكيم التى تلجأ إليها المنشأة للمفاضلة ما بين المرونة فى العملية الإنتاجية وبين التخزين.

الجدول رقم (١) مستويات التنبؤ

التموين من المواد الأولية	التصنيع	التغليف	المخزون
عند الطلبية	عند الطلبية	عند الطلبية	لا يوجد
بالتنبؤ	عند الطلبية	عند الطلبية	مواد أولية
بالتنبؤ	عند الطلبية	عند الطلبية	منتجات نصف نهائية
بالتنبؤ	بالتنبؤ	بالتنبؤ	منتجات نهائية

يجب التفكير إذن عند تصميم نظام التنبؤ بشكل انسياب التدفق من المواد (تدفقات بسبب التنبؤ وتدفقات مسحوبة بواسطة الطلبيات)، ومن ثم يجب أن يستند التنبؤ إلى الحاجات الحقيقية للمنشأة.

## ٢-٣- مستوى حساب التنبؤ والتحقق من صلاحيته:

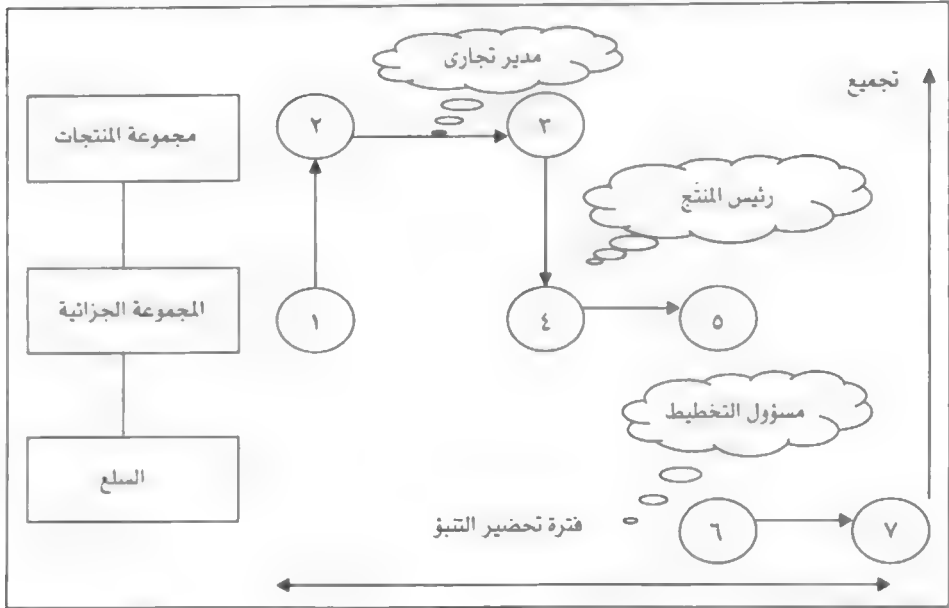
يتم تحديد مستوى تطبيق الحساب الإحصائى بناء على العلاقة الموجودة فى تدرج المعطيات التى عالجناها سابقاً، أى بناء على التدرج حسب المنتج أو حسب الحيز الجغرافى أو منافذ التوزيع. ولأسباب تتعلق بالفعالية الإحصائية وبالمعالجة الآلية فإنه نادراً ما يتم تطبيق الحساب الإحصائى على المستويات الدقيقة جداً. وتتلحق عملية اختيار مستوى تطبيق الخوارزمية المستخدمة بالتجانس فى سلوكيات المستويات الأدنى. ففى الواقع، إذا كنا نتعامل مع مستوى مُجمع بشكل كبير وكانت السلوكيات غير متجانسة (كما هو الحال غالباً)، فإن حركات الاتجاه العام للمنتجات لن تكون معبّرة، ومن ثم فإن التنبؤ سيكون متحيزاً. بالمقابل، إذا كنا نتعامل مع مستوى منخفض كثيراً حسب تدرج المنتج، فإن ذلك يقود إلى حسابات للتنبؤ غير معنوية، وتكون القوانين الإحصائية المستخدمة للحساب غير صحيحة.

يمكن الحصول على التنبؤات على كل المستويات من خلال تنفيذ طريقة الحساب على مستوى متوسط ومن ثم استخدام دالات للتجميع أو للتفريق تسمح بإعادة تشكيل كل المستويات.

ومثال على ذلك، في حال استخدام تدرج المنتج فقط فإن الحصول على التنبؤات يمكن أن ينتج عبر العملية المشروحة في الرسم التوضيحي رقم (٣).

- المرحلة (١): حساب التنبؤ على مستوى المجموعة الجزئية بواسطة نموذج إحصائي ما.
- المرحلة (٢): تجميع التنبؤات على مستوى مجموعة المنتجات.
- المرحلة (٣): التأكد من صلاحية الحساب من خلال الاستعانة بالمدير التجاري للتنبؤات حسب المجموعات.
- المرحلة (٤): تقسيم التنبؤات حسب المجموعات، التي تم التأكد من صلاحيتها، إلى تنبؤات حسب المجموعات الجزئية.

الرسم التوضيحي رقم (٣) عملية تحضير التنبؤ



- المرحلة (٥): التحقق من التنبؤات بواسطة رئيس المنتج على مستوى المجموعات الجزئية.
- المرحلة (٦): تقسيم التنبؤات التي تم التحقق من صلاحيتها في المرحلة السابقة إلى تنبؤات على مستوى السلعة الواحدة.
- المرحلة (٧): التحقق من تنبؤات المرحلة (٦) السابقة بواسطة مسؤول التخطيط.

ليس هناك من مشكلة فيما يتعلق بعملية تجميع التنبؤات، وكفى فقط إضافة المكونات للمستوى المرغوب فى الاستعلام عنه. ولكن بالنسبة لعملية تقسيم أو توزيع التنبؤات، فإن هناك عدة إمكانيات لحساب التثقيات النسبية لكل سلعة، منها:

- التثقييل باستخدام الوزن السابق للشهر نفسه من العام المنصرم. وميزة هذه الطريقة تكمن فى دمج المركبة الفصلية فى تثقيات السلعة، ولكنها تعاني من سلبية تتعلق بخطر الأخذ بعين الاعتبار للقيم الشاذة للسلع ذات المبيعات القليلة.
- التثقييل وفقاً للمتوسط المحسوب على مدى (١٢) شهراً منزلقاً. وتسمح هذه الطريقة بحساب تثقيات فعالة لأنها تكون محسوبة على مدى العام. ولكن التقلبات الجديدة التى تحصل على مركبة الاتجاه العام للسلع المختلفة لا تكون مأخوذة بعين الاعتبار. ومن ثم فإن ضغطاً ترويجياً متزايداً على سلعة ما سيؤدى إلى تنمية مبيعات تلك السلعة مع الضرر للسلع الأخرى المجاورة لها، ومن ثم حصول تحيز فى عملية حساب التثقيات.
- التثقييل وفقاً للمتوسط الصقيط المحسوب على مدى (١٢) شهراً منزلقاً. وهذه التقنية تعتبر الأفضل، لأنها تعطى تثقيات مهمة للمعطيات الحديثة السابقة من السلسلة ولمدة (١٢) شهراً. ويمكن الحصول على الصقل عبر استخدام تقنيات الصقل الآسى البسيط واعتبار المعامل  $a = 0.3$ .

## ٢-٤- دورية تحديث التنبؤ:

من الواضح أن التنبؤ على المستوى السنوى أسهل من التنبؤ الشهري، والشهري أسهل من الأسبوعي، وهكذا، ولذلك فإنه يتوجب على المنشأة منذ البداية أن تحتكم ما بين صعوبة التنبؤ وبين جودته مما يسمح لها بأن تكون فعالة فى السوق. فعلى سبيل المثال، ليس هناك من فائدة لإجراء تنبؤات أسبوعية مستمدة من وجود انحرافات معيارية كبيرة (بسبب التباين الأسبوعي الكبير) فى حين أنه من الممكن التحكم بشكل جيد وسهل للحصول على تنبؤات شهرية.

يتوجب عند إنشاء نظام التنبؤ اختيار الدورية المناسبة لتحديث التنبؤ نظراً لأهمية هذا الخيار، ولكونه يقيد الكثير من العناصر المستخدمة فى عملية التنبؤ مثل دورية المعطيات المستخدمة واختيار طريقة التنبؤ.

المعايير الممكن الاعتماد عليها بهذا الخصوص هى التالية:

### - دورة الإنتاج والفترة اللازمة لتعديل خطة الإنتاج والتموين:

يجب أن تكون دورية التنبؤ متوافقة مع دورة الإنتاج للمنتج المراد التنبؤ بمبيعاته. فمن غير المفيد إنشاء نظام تنبؤ أسبوعي في حال كانت دورة الإنتاج (أو فترة ردة الفعل للمنشأة) أكثر من أسبوع.

### - المجال الزمني للتنبؤ:

لن يكون واقعياً إنشاء تنبؤات أسبوعية للمبيعات لمجال زمني يتجاوز (٢٠) أسبوعاً. فإذا شعرت المنشأة بالحاجة لمثل هذه الفترات، عليها استخدام نظامين من أنظمة التنبؤ، واحد شهري والآخر أسبوعي مع الاحتفاظ بالتجانس بينهما كما سنرى في الفقرة اللاحقة (٢-٥).

### - تأثير العوامل التفسيرية:

يعتبر تأثير العوامل التفسيرية معياراً مهماً لاختيار دورية التنبؤ. ففي قطاع السلع ذات الاستهلاك الكبير، يكون لمعظم التأثيرات الترويجية صدى ينتهي مع نهاية الأسبوع، وعملية إدخال هذه التأثيرات في نظام التنبؤ تستلزم استخدام دورية تحديث أسبوعية. بالمقابل فإن المؤشرات الاقتصادية المعروفة بشكل أسبوعي، لا يمكن أن تظهر إلا في أنظمة التنبؤ الشهرية.

إذن على كل منشأة أن تختار الدورية المناسبة لإجراء التنبؤ بالاستناد إلى العناصر السابقة، ويمكننا عموماً، وفقاً لقطاع النشاط، أن نشير إلى العناصر التالية:

- الحالة العامة: تنبؤ شهري.
- حالة المنتجات الطازجة: تنبؤ أسبوعي.
- حالة المنتجات الطازجة جداً: تنبؤ يومي.
- حالة الخدمات: تنبؤ يومي أو ساعي أو حسب بعض الشرائح الزمنية.

### ٢-٥- التجانس بين التنبؤات الشهرية والتنبؤات الأسبوعية:

قد تلجأ المنشآت أحياناً إلى استخدام نظامين مختلفتين للتنبؤ من ناحية الدورية المتبعة، ومثال ذلك استخدام تنبؤ شهري لمجال قدره (١٨) شهر وتنبؤ أسبوعي لمجال قدره (١٠) أسابيع، وذلك بهدف تحديد الاحتياجات من المواد Material Requirements Planning. إذن لدى المنشأة مجموعتان من المعلومات غير متجانستين، فالتنبؤات يتم حسابها بشكل مستقل الواحدة عن الأخرى، كما أن الأسبوع يمكن أن يكون متداخلاً بين شهرين.



ولجعل هذين النوعين من التنبؤ متجانسين، نجرى الافتراضين التاليين:

- التنبؤ الأسبوعي على المدى القصير أكثر فعالية من التنبؤ الشهري، لأنه يحتوى على المعلومة الأكثر حداثة (القيم المحققة للشهر الجارى).
- التثقييل المتساوى لكل يوم من أيام الأسبوع، فليوم الإثنين وزن مساوٍ لوزن يوم الثلاثاء ... إلخ.

المثال التالى يوضح مبدأ إجراء التجانس بين التنبؤات. ليكن لدينا التنبؤات الأسبوعية والشهرية المعروضة فى الجدول رقم (٢).

الجدول رقم (٢) التنبؤات الأسبوعية والشهرية قبل إجراء التجانس

الشهر	التنبؤ	الأسبوع	التنبؤ
تشرين الأول	٥٦٩	٤٠	٨٦
		٤١	١٠٦
		٤٢	٩٨
		٤٣	١٢٩
		٤٤	٨٨
تشرين الثانى	٧٢٠	٤٥	١٤٥
		٤٦	١٧٨
		٤٧	١٢٥
		٤٨	١٤٢
كانون الأول	٨٥٤	٤٩	١٩٥

تقضى طريقة حساب التجانس بين التنبؤات بإجراء النسبة للتنبؤات الأسبوعية المتداخلة بين شهرين إلى عدد أيام الأسبوع. يوضح الجدول رقم (٣) قواعد الحساب.

الجدول رقم (٣) التنبؤات الأسبوعية والشهرية بعد إجراء التجانس

الشهر	التنبؤ	الأسبوع	التنبؤ
تشرين الأول	٤٤ فيه يومان في شهر تشرين الأول و ٣ أيام في شهر تشرين الثاني	٤٠	٨٦
		٤١	١٠٦
		٤٢	٩٨
		٤٣	١٢٩
		٤٤	٨٨
تشرين الثاني	٤٨ فيه ٤ أيام في شهر تشرين الثاني ويوم واحد في شهر كانون الأول	٤٥	١٤٥
		٤٦	١٧٨
		٤٧	١٢٥
		٤٨	١٤٢
كانون الأول	٨٥٤	٤٩	١٩٥

## ٦-٢- استخدام سجل الطلبيات Order Book:

نتساءل هنا عن كيفية الاستفادة من سجل الطلبيات لتحسين جودة التنبؤ بالمبيعات. في الواقع إذا كانت الفترة اللازمة للمنشأة لتعديل خطة إنتاجها أو خطة تموينها من المواد الأولية أقل من مهلة التسليم المطلوبة من قبل معظم الزبائن، فإن الأخذ بعين الاعتبار لسجل الطلبيات باعتباره مؤشراً تقديماً (متغير تفسيري) يمكن أن يكون مفيداً. ومثال ذلك، امتلاك المنشأة لسجل طلبيات يعادل وسطياً (٥٠٪) من مبيعاتها قبل شهر من تاريخ التسليم المطلوب. الهدف إذن هو تنقية (تخليص) التنبؤات القصيرة جداً (للسهر الجاري) من خلال إدخال سجل الطلبيات لمجال زمني واحد أو لمجالين زمنيين مختلفين في معادلة تقدير المبيعات.

مثال: تقوم منشأة تعمل في مجال السلع الاستهلاكية المعمرة وتعتمد أسلوب الطلبيات المسبقة باستخدام النموذج التالي:

$$VEMTES_t = a_0 + a_1 CAR_{t-1} + a_2 CARJ5_t$$

حيث:

 $VENTES_t$ : تمثل المبيعات للشهر  $t$ . $CAR_{t-1}$ : سجل الطلبات في الـ (٢٠) من الشهر  $t-1$  لتسليمها في الزمن  $t$ . $CARJ5_t$ : سجل الطلبات في الـ (٥) من الشهر  $t$  لتسليمها في الزمن  $t$ . $a_2, a_1, a_0$ : معاملات التثقيل المقدرة بواسطة الانحدار.

نعرض في الجدول رقم (٤) المعطيات المتعلقة بالمبيعات وبتطور سجل المبيعات.

الجدول رقم (٤) المبيعات والتغير في سجل الطلبات (الملف KLS. C10EX1)

التاريخ	المبيع	Carnet t-١	Carnet au ٥	التنبؤ
كانون الثانى A	٤٠١,٦٠	٨٤	١٨١	٣٦٨
شباط	٣٩٥,٧٠	٧٢	٢٣٨	٤٥٩
آذار	٤٥١,٠٠	٦٩	٢٠١	٣٦٧
نيسان	٤٢٧,٦٠	٨٦	٢٢٨	٤٧٧
أيار	٤٩٦,٨٠	٧٦	٢٢٣	٤٤٧
...	...	...	...	...
...	...	...	...	...
تشرين الثانى	١٠١٢,٠٠	١٢٢	٤٢٢	١٠١٠
كانون الأول	١٣٨٠,٠٠	١٨٠	٥١٠	١٣٧٨
كانون الثانى ٣+A		١٠٢	٢٨٨	٦٥٨

نتائج التقدير بواسطة الانحدار المتعدد هي التالية:

$$VENTES_t = -279.65 + 3.04 CAR_{t-1} + 2.18 CARJ5_t$$

(4.6)                      (9.47)

$$R^2 = 0.98 \quad n = 63 \quad (..) \quad t \text{ de Student}$$

من الواضح أن المعاملات مختلفة بشكل معنوى عن القيمة صفر.

يمكن إذن للتنبؤ بشهر كانون الثاني من العام  $A + 3$  أن يكون مصفى اعتباراً من (٦) كانون الثاني بفضل القيم المعلومة لسجل الطلبيات لذلك اليوم.

$$VENTES_{JA+3} = - 279.65 + 3.04 (102) + 2.18 (288) = 658.27$$

## ٧-٢- الحلول الآلية:

بعد استعراضنا للإجراءات المتعلقة باتخاذ القرار حول شكل نظام التنبؤ الواجب استخدامه، يأتى موضوع اختيار البرنامج الآلى المناسب لهذا النظام. لذلك من المناسب أن نعرض هنا إجمالى الخيارات المتاحة بهذا الخصوص ونبين الإيجابيات والسلبيات لكل خيار.

وعلى الرغم من أن إجراءات الاستخدام النهائى لنظام التنبؤ تكون من اختصاص أقسام التسويق والتمويل، فإن ذلك لا يمنع من الأخذ بعين الاعتبار لرأى قسم المعلوماتية حول مدى إمكانية تثبيت هذا النظام أو ذاك، وطرائق التشغيل المحتملة (حاسب مكتبى، شبكة، ... إلخ).

تعتبر التحسينات المتزايدة فى كفاءة أجهزة الحاسوب وكذلك اللجوء المتزايد إلى البرمجيات البسيطة للحساب، عوامل مشجعة لاستخدام البرمجيات الجاهزة لإجراء التنبؤ.

ولن نعرض هنا كل البرمجيات المتاحة للتنبؤ، وإنما يمكن للمهتم بالاطلاع على برامج أخرى العودة إلى الموقع التالى على الشبكة العنكبوتية:

<http://www.dauphine.fr/cip/pages/bourbonnais/>

يمكننا أن نعرض هنا خمسة أنماط مختلفة من نماذج البرمجيات التى تعالج مسائل التنبؤ:

### - البرنامج المخصص للتنبؤ بالمبيعات:

يمكننا عبر هذا البرنامج تحضير تنبؤات جيدة لسلاسل المبيعات، حيث يتم التعريف بشكل واضح لمعطيات الإدخال (السلاسل الزمنية للمبيعات) وللمخرجات (التنبؤات والانحراف المعيارى لخطأ التنبؤ).

### - المزايا:

- السرعة فى التثبيت والحصول الفورى للتنبؤ.

- اعتماد البرنامج على عدد كبير من المراجع وعلى مواقع متخصصة فى شبكة الإنترنت يجعل آلية عمله مؤكدة.
- تكلفته معروفة بدقة.
- أدواته محددة بشكل كامل ويمكن للمستخدم التعرف على فحواها بشكل سهل.
- السلبيات:

- البرنامج مصمم بحيث يناسب أكبر عدد ممكن من المنشآت ومن ثم هناك احتمال لعدم توافقه مع تطبيق محدد.
- عمليات التطوير والتعديل النوعية على هذا البرنامج تكون مستحيلة أو مكلفة جداً.
- ليس لقسم المعلوماتية فى المنشأة أية سيطرة على البرنامج، فهو مرتبط كلياً بالموارد الذى يستطيع وحده إجراء أى تطوير أو تعديل فيه.
- البرنامج المتكامل من النوع "Supply chain":

يقدم هذا البرنامج الحل الأمثل لكل مراحل العملية اللوجيستية فى المنشأة ابتداء بالتنبؤ بالطلب حتى الوصول إلى إدارة المخزون فى المستودعات. بالإضافة إلى الإيجابيات والسلبيات العامة المتعلقة بالبرمجيات الجاهزة، هناك ميزة لهذا البرنامج تتمثل فى كونه قادراً، من خلال عملية واحدة، على إيجاد الحل لكل المسائل المتعلقة بالعملية اللوجيستية للمنشأة. ولكن سلبيته الكبرى تتمثل فى تكلفته الباهظة ووضعه موضع التنفيذ.

#### - البرنامج من النمط "ERP, Enterprise Resource Planning":

يمكن من خلال البرنامج ERP التحكم بكل أوجه إدارة المنشأة ويمكن، من خلال تطبيق ما لهذا البرنامج، إجراء تنبؤ بالمبيعات. إن المفردات المستخدمة فى هذا البرنامج (محاسبة، إدارة مبيعات، إدارة أفراد، ...) موجهة بشكل أساسى نحو الإدارة وبشكل أقل نحو التمويل وأقل أكثر نحو التنبؤ بالمبيعات. ونتيجة لذلك فإن الوسائل المستخدمة فى هذا البرنامج غالباً ما تتميز ببساطتها.

#### - البرنامج المبسط لمعالجة البيانات الإحصائية Tableur:

إن التطور الذى حصل على هذا النوع من البرامج وتعميم استخدامها فى المنشآت جعل منها أداة مناسبة لإجراء التنبؤ بالمبيعات.

- المزايا:

- يمكن لنظام التنبؤ أن يكون عبر مجموعة البرامج المكتبية.
- يمكن تعديل طريقة الحل بشكل سريع.
- المستخدم لهذا النظام والقادر على تعديله تكون لديه معرفة تامة بآلية عمله.

- السلبيات:

- محدودية استخدام هذا البرنامج بعدد محدود من المنتجات، وفي حال كون عدد المنتجات الواجب التنبؤ بمبيعاتها كبيراً فإن استخدامه يصبح مضجراً.

- تفصيل برنامج حسب الحالة:

يتم اللجوء هنا إلى تفصيل كامل أو جزئي لتطبيق ما من قبل قسم المعلوماتية الخاص بالمنشأة، وغالباً ما يكون مزيجاً من تضافر الجهود للمختص في قواعد البيانات ولعدد النتائج على الجدول.

- المزايا:

- يسمح التصميم الدقيق للبرنامج بالتأكد من ملاءمته لأنظمة المخزون.
- يمكن استثمار النتائج مباشرة من الجدول ويكون مدير البرنامج مسيطراً بشكل كامل على أدواته.
- يكون لقسم المعلوماتية الكفاءة لأى تعديل يراه ضرورياً في البرنامج.

- السلبيات:

- فترة تصميم البرنامج واختباره قد تكون طويلة.
- النتيجة غير مؤكدة. فالأقسام الداخلية في المنشآت ليس لديها أى التزام تجاه النتائج مقارنة بالأقسام من خارج المنشأة، ومن ثم فقد لا يرى هذا المشروع النور.

- معايير الاختيار بين البرامج:

الاختيار بين البرامج المتوافرة هو عملية صعبة. والمعيار الأول لهذا الاختيار هو جودة التنبؤ، ويتم ذلك بإجراء اختبار على عينة كافية من سلسلة نرغب في التنبؤ بقيمتها ومكونة من المبيعات الممثلة لنشاط المنشأة.

فى حال كانت النتائج تتوافق مع القيم المتوقعة مع وجود برامج أخرى منافسة، فيمكن عندئذ اللجوء إلى معايير أخرى متممة وتشمل:

- ملاءمته للمستخدم: فالإدارى يستخدم عادةً البرامج المكتبية، وفى حال عدم ارتياحه للبرنامج الجديد فقد يثير ذلك لديه السخط والملل.
- دوام استمرارية وجود الجهة المصممة للبرنامج: فهناك عدة عوامل يجب أخذها بعين الاعتبار عند التعامل مع جهة خارجية منها قدم هذه المنشأة وقدراتها المالية وعدد العاملين فيها ... إلخ. فمعظم المصممين لهذه البرامج الخاصة بالتنبؤ هم من الحجم الصغير بسبب السوق المحدود جداً لهذا الموضوع، وبسبب الخطر الكبير فى الإخفاق.
- المساعدة التقنية: نقصد هنا المساعدة المنهجية أى فى الطريقة المستخدمة والمساعدة فى مجال الاستخدام لأدوات البرنامج. فوجود خط ساخن وأدوات مساعدة مطبوعة يعتبر عاملاً مهماً فى اختيار البرنامج.
- القدرة على التحكم والتعديل للبرنامج: فوجود المنافسين من داخل المنشأة يعتبر عنصراً مهماً حيث لا يتمتع موزعو البرامج (غير المصممين له) بالقدرة على إجراء أى تعديل سريع مطلوب من قبل المستخدمين.
- السعر: يأتى معيار السعر فى المرتبة الأخيرة لأنه، من وجهة نظرنا، ليس أساسياً على الأقل ضمن حدود معقولة. فالنفقات الإضافية المترتبة على عدم احترام المعايير السابقة قد تفوق المبالغ الموفرة من عملية الاختيار لبرنامج رخيص.
- الإنترنت والتعاون فى إجراء برنامج للتنبؤ:

التطور الحاصل على شبكة المعلوماتية (الإنترنت) يعطى للمنشأة الإمكانية فى التواصل ومبادلة المعلومات بين مختلف مصممي برامج التنبؤ بالمبيعات. فكل يسهم بالمعلومات المرسله عبر الشبكة، فى تطوير نظام التنبؤ وتحسينه للوصول إلى النظام الأمثل. تستفيد حالياً كل البرامج المتوافرة من هذه الميزة فى التعاون.

### ٣- طريقة إدخال التنبؤ فى نظام الإدارة:

كما أشرنا سابقاً، من الضروري تكوين فريق للتنبؤ يجمع كل ذوى الشأن بموضوع التنبؤ والغاية من ذلك تنظيم أفكار عناصر هذا الفريق التى يمكن أن تكون مختلفة. علينا أولاً أن نأخذ بعين الاعتبار المحاولات السابقة التى كانت تسعى إليها المنشأة بموضوع التنبؤ، ومن ثم إدخال الشخص أو الأشخاص المعنيين بهذا الأمر ضمن فريق التنبؤ. وهذا ليس بالأمر السهل دائماً، فالمنشأة عبارة عن مجموعة من الأفراد والعلاقات بين هؤلاء قد تكون توافقية وقد تكون خاضعة للسلم الوظيفى.

وهناك سؤال يتعلق بالجهة أو القسم الذى سيرتبط به نظام التنبؤ، وبهذا الصدد يجب تجنب اعتبار نظام التنبؤ باعتباره جزءاً من صلاحيات قسم الموظفين أو المعلوماتية أو التسويق أو قسم التنبؤ؛ لأن ذلك سيؤدى إلى عزل فريق التنبؤ الإجمالى. التنبؤ يجب أن لا يكون مرتبطاً إلا بالفريق المتعدد التخصصات الذى يطور ويديره ويسهل استخدامه. وهذا بالتأكيد يفرض بعض المشاكل المتعلقة بالإجراءات الاعتيادية لتعريف المهام الوظيفية والسلم الوظيفى، وكذلك مخصصات الميزانية من الموارد. يمكن حل هذه المسائل من خلال تطوير نظام التنبؤ وجعله مرتبطاً فى مراحل الأخيرة بالإدارة العامة للمنشأة (حيث يكون موضوع الميزانية والقرار النهائى فى حال عدم التوافق من اختصاص الإدارة العامة).

الطريقة الأكثر فعالية لإدخال التنبؤ فى نظام الإدارة تقضى بتنظيم دورة معلومات داخلية تسمح بتعريف مناسب لنظام التنبؤ وتسهل عملية استخدام النظام من قبل المستخدمين. ويمكن من أجل ذلك تنظيم دورة من عدة أيام موزعة على شهر أو شهرين وتتعلق بالمواضيع التالية:

- مدخل إلى الطرائق الإحصائية والتنبؤ.
- شرح لنظام التنبؤ.
- الطريقة العملية للاستخدام بواسطة الحاسب الآلى وتفسير النتائج وكيفية اختيار العناصر التفسيرية، ... إلخ.

### ٣-١- التنبؤات الأولية:

يجب عدم إعطاء أهمية كبيرة للتنبؤات الأولية لنظام التنبؤ ولا يجب اعتبارها مؤشراً نهائياً على دقة النظام، ففعالية النظام ستزداد وتحسن بشكل متتالي عبر إدخال بعض المتغيرات التفسيرية الإضافية. ومن ثم فإنه من السابق لأوانه اعتبار التنبؤات الأولية ذات جودة ثابتة. ولكن يمكننا أن نعرض فى بداية الأمر وبشكل متوازٍ كلاً من التنبؤات الحدسية والتنبؤات المحققة عبر النظام الجديد، ولقد لوحظ من خلال التجربة أن التنبؤات الأخيرة تكون مساوية، إن لم تكن أفضل، من التنبؤات الحدسية.

بعد ذلك يتم بشكل متدرج إدخال عناصر جديدة إلى النظام (تحسينات فى جودة النظام، متغيرات تفسيرية جديدة، سلاسل زمنية أكثر طولاً، ... إلخ) مما يسمح بتحسين جودة التنبؤ. يتميز هذا الإجراء بكونه يوضح بشكل رقمى الرهان الأساس وهو أن التنبؤ لا يتم بشكل كامل من تلقاء نفسه، وإنما يتم تحسينه تدريجياً ويبقى على الدوام أسرع من الطرائق التقليدية.



## ٣-٢- التنبؤ كأداة من أدوات المنشأة:

يحتاج التنبؤ إلى فترة تقديرية لا تتجاوز (١٨) شهراً حتى يكتمل داخل المنظمة. وضمن هذا المنظور الزمنى يبرز مجالان:

- مجال قصير الأمد من (٣) إلى (٦) أشهر يتعلق بتحديد أهداف البيع وأهداف برامج الإنتاج.

- مجال ممتد من (١٢) إلى (١٨) شهراً مرتبطاً بإجراءات الميزانية.

ويمكن لنظام التنبؤ نفسه إمداد الإدارة بالعناصر الواجب إدخالها فى كلا المجالين. فمن أجل المؤسسة التى تنظم ميزانياتها للفترة من كانون الثانى إلى كانون الأول (معظم الحالات)، فإن الإجراء المتعلق بالميزانية للسنة  $n$  سيبدأ اعتباراً من شهر تموز من العام  $n - 1$ .

وستكون الإصدارات من التنبؤات الفصلية (كل ٣ أشهر) على النحو التالى:

- فى تموز، سيكون هناك تنبؤ إجمالى لمدة (١٨) شهراً للموازنة، وتنبؤ دقيق لـ (٦) أشهر لأهداف البيع ولبرامج الإنتاج.

- فى تشرين الأول سيكون هناك تنبؤ متعلق بالميزانية لفترة (١٥) شهراً (١٨-٣) وتنبؤاً لمدة (٦) أشهر لأهداف البيع وبرامج الإنتاج، .... إلخ.

وهكذا شيئاً فشيئاً يتقارب المجالان الزمنيان مع مرحل تنفيذ الميزانية ومن خلال ملاحظة الانحرافات بين القيم المتنبأ بها، والقيم المحققة سيتم تصحيحها عبر تعديل ما فى قرارات الإدارة.

يتميز النظام الذى يلبي احتياجات الإجراءين السابقين بميزة مهمة تتمثل بإدخاله نوعاً من التجانس بين المجالين الزمنيين. فبممكننا تصور وجود اختلافات مهمة بين الإجراء المتعلق بالميزانية، والذى له أدواته الخاصة فى التنبؤ (أو لا يستخدم أداة للتنبؤ) وبين الإجراء المتعلق بالمجال (٣) إلى (٦) أشهر، والمستند إلى نظام مستقل فى التنبؤ.

فى المرحلة الأخيرة لعملية إدخال التنبؤ فى نظام الإدارة يتم حساب الكلفة الحقيقية لتثبيت هذا النظام التنبؤى ومقارنة ذلك مع مدى ما يقدمه من فوائد للمنشأة. هذه التقييمات يمكن أن تكون منفذة بعد مرور (١٨) إلى (٢٤) شهراً من الاستخدام الأولى للنظام، وبعد ذلك يتم التقييم بشكل سنوى. ويكون لفريق التنبؤ دور أساسى فى هذه المرحلة حيث يتوجب عليه إجراء التعديلات المستمرة على النظام لتحسين أدائه.

### ٣-٣- الفترة اللازمة لتثبيت النظام:

غالباً ما يتم الاعتقاد بأنه يكفي تثبيت البرنامج ومن ثم إدخال البيانات، وبعد ذلك يصبح البرنامج جاهزاً لتقديم التنبؤات المطلوبة. ولكن الواقع بعيد عن ذلك، فهذا النظام متداخل في هيكلية المنشأة، ومن ثم يجب أن يكون متفقاً عليه من قبل الجميع وليس حصراً بقسم ما من أقسام المنشأة.

ولكى يصبح هذا النظام متاحاً بشكل عملي للاستخدام فإنه يلزمه من الوقت ما يقارب سنة ونصف إلى سنتين. ومن خلال التجارب السابقة، يمكننا توزيع فترة استكمال تحضير البرنامج إلى المراحل التالية:

- تحضير مشروع اقتناء نظام للتنبؤ: (٢) أشهر.
- تأليف الفريق والتعريف بآليات تثبيت النظام: (٤) أشهر.
- اختيار البرنامج المناسب: (٢) أشهر.
- ملائمة أدوات النظام والتعريف بها: (٤) أشهر.
- تجريب النظام واختباره: (٦) أشهر.
- أى ما مجموعه تقريباً (١٨) شهراً.

ومن الواضح أن العمل في المراحل السابقة لا يتم بشكل مستمر، فلكل عضو في الفريق مهام أخرى مرتبط بها، ولا يكون متفرغاً لعمل النظام إلا قرابة يوم واحد وسطياً في الشهر.

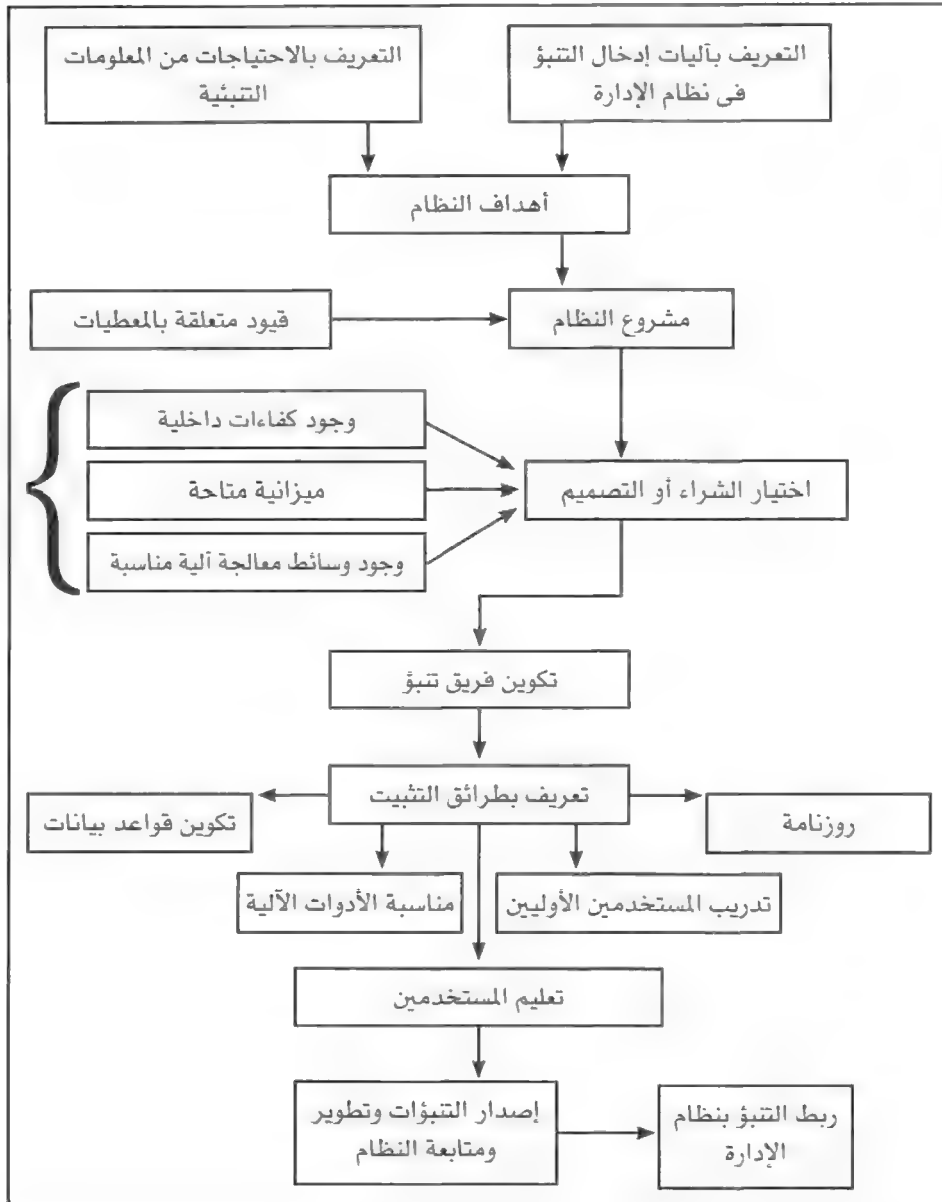
### ٣-٤- التكلفة:

يتم عادة تقدير تكلفة اقتناء نظام التنبؤ بشكل غير دقيق، وذلك لأن هذه التكلفة تشمل شقين: منها ما هو داخلي (رواتب الفريق، تكاليف المعالجة الآلية، ...)، ومنها ما هو خارجي (مكتب استشاري، شراء البرنامج، تدريب، ...) <sup>(١)</sup>. ويتم تقدير التكاليف الداخلية بشكل هامشي كونها معتبرة تكاليف ثابتة في بنود الميزانية وتُعطى قيمة أقل من حقيقتها رغم كونها تمثل الجزء الأكبر. أما التكاليف الخارجية فتقيم كما هي بمجمل تفاصيلها، ومن ثم فإن المقارنة بين التكاليف الداخلية والخارجية تكون لمصلحة الداخلية كونها الأقل. وقد يحصل أن تخصص منشأة ما مبلغاً يعادل (١٠٠٠٠) يورو نفقات خارجية لاقتناء نظام للتنبؤ، وفي الوقت نفسه تنفق ضعفين أو ثلاثة أضعاف هذا المبلغ نفقات داخلية للحصول على النتائج نفسها!

(١) أسعار البرمجيات المتعلقة بالتنبؤ معروضة على موقع الإنترنت.

لتلخيص مفردات هذه الفقرة، فقد عرضنا فى الرسم التوضيحي رقم (٤) مختلف الخطوات لتعريف وتثبيت نظام التنبؤ.

الرسم التوضيحي رقم (٤) المراحل المختلفة لتعريف وتثبيت نظام التنبؤ



#### ٤- البحث عن العوامل التفسيرية ومصادر المعلومات:

بشكل مواز لعملية تثبيت نظام التنبؤ يُطرح موضوع البحث عن المتغيرات التفسيرية وبشكل خاص في المجال الصناعي. ولهذا السبب فقد قررنا أن نضع في نهاية هذا الفصل قسماً يتعلق بمعالجة أنماط المعطيات الاقتصادية ومصادر المعلومات الإحصائية.

#### ٤-١- تصنيف المعطيات:

##### - معايير المفاضلة بين المعطيات:

يمكن للمعطيات أن تكون كاملة exhaustives تغطي المجتمع الإحصائي بمجمله، أو قد تكون جزئية مأخوذة من عملية استطلاع للرأى sondage أو بواسطة عينة من المجتمع الأم. بالنسبة للنوع الأول يتم جمع البيانات لإجمالي المجتمع في حين أن مفردات النوع الثاني تكون مأخوذة بواسطة عينة ممثلة للمجتمع الذي سُحبت منه ومثالها البيانات المتعلقة بمجموعات الاختبار Panels من المستهلكين أو من الموزعين، التي سبق أن تحدثنا عنها.

كما يمكن للمعطيات أن تكون مختلفة تبعاً للأزمنة الفاصلة بين مفرداتها (دورية المعطيات périodicité) فقد تكون يومية، أسبوعية، نصف شهرية (مرتين بالشهر)، شهرية، نصف فصلية (مرة كل شهرين)، فصلية (مرة كل ثلاثة أشهر)، نصف سنوية و سنوية. أما المحتوى contenu فهو يمثل بعض القياسات الأساسية للبيانات كنوع النشاط (إنتاج، استهلاك، تسليم بضائع، طلبات، سجل الطلبات، ...)، السعر، المخزون، الاستيراد، التصدير، ... إلخ. كذلك هناك الوحدة الأساسية للإحصاء unite de base d'une statistique التي يمكن أن تكون رقماً قياسياً أساسه (١٠٠) في تلك السنة. أو وحدة حجم أو وحدة نقدية. وهذه الوحدة الإحصائية قد تكون خاماً أو مصححة من أيام العمل الفعلية CJO، أو من التقلبات الفصلية CVS. ويختلف التفسير حسب الوحدة الإحصائية المستخدمة.

كما يمكن أن تختلف البيانات حسب الامتداد الجغرافي الذي تغطيه، فهناك البيانات الداخلية على مستوى المنشأة والبيانات الخارجية التي غالباً ما تكون معدة على المستوى الوطني. ولا بد هنا من التساؤل فيما إذا كانت البيانات الخارجية تشمل فرنسا فقط أو المناطق أو الأراضي ما بعد البحار (المستعمرات). ولذلك فإنه ليس هناك من توافق بين الامتداد الجغرافي النظري وبين ما يغطيه فعلاً التجميع الإحصائي للبيانات من وجهة النظر الإقليمية. وهذه الخلاصة تبقى صحيحة بالنسبة

للكثير من المعطيات الداخلية، فالمنشأة التي تعتبر نفسها من المرتبة الوطنية، ولكن ليس لديها أنشطة حقيقية إلا على نصف الأراضي الفرنسية، فإنها لا تجرى إلا إحصاءات محلية. ومن ثم فمن المفضل اللجوء إلى استخدام السلاسل التفسيرية المحلية وغالباً ما تكون موجودة، ولكن نادراً ما تكون منشورة. أخيراً، يشار إلى أن التقسيمات الجغرافية الرسمية لا تتطابق أبداً مع التقسيمات الخاصة بالمنشأة.

#### - معايير الاختيار:

المعيار الأول لاختيار المعطيات يتعلق بشرط وضوح تحليل الانحرافات ما بين التنبؤات والقيم المحققة فعلاً. مبدئياً، يُعتبر التنبؤ المستند إلى معطيات السوق الوحيد الذى يسمح بفصل حقيقى بين ما يمكن إرجاعه إلى تطور فى بيئة السوق وبين ما يشير إلى النجاح النسبى للمنشأة مقارنة بأهدافها. ولا يجب أن يستند التنبؤ إلى أرقام المنشأة إلا فى حالة كون معطيات السوق غير موجودة أو قليلة الثقة.

تأتى الجودة بالمعنى الإحصائى فى المركز الثانى باعتبارها معياراً من معايير اختيار المعطيات. والحد الأدنى لطول السلسلة المطلوب لقياس الجودة هو (٣٦) شهراً، ويمكن أن يزداد إلى (٤) أو خمس سنوات أى (٤٨) إلى (٦٠) قيمة شهرية فى حال رغبتنا فى دراسة التأخيرات الزمنية لعدة أشهر، وإجراء الانحدار على ثلاثة أو أربعة متغيرات. كما يجب أن يكون هناك توافق فى دورية البيانات المستخدمة، فليس ممكناً استخدام سلسلة زمنية ذات دورية نصف سنوية لشرح التقلبات الشهرية فى المبيعات والحصول على التنبؤات على المستوى الشهرى. كما يجب أن يكون هناك تجانس بين السلاسل المستخدمة فيما يتعلق بنزع المركبة الفصلية. فإذا كانت السلسلة المراد التنبؤ بها مغلّصة من التقلبات الفصلية أى CVS، فإن جميع السلاسل التفسيرية يجب أن تكون أيضاً مغلّصة من التأثيرات الفصلية.

المعيار الثالث لاختيار المعطيات يتعلق بالمجال الزمنى للتنبؤ، فالإحصائيات المتعلقة بالمتغيرات ليست جميعها متوافرة فى الفترات نفسها، ومن ثم يجب اختيار تلك التى يمكن الحصول عليها بشكل سريع. والمعيار الأخير هو المتعلق بالموثوقية، فالإحصاء الموثوق به يجب أن يكون صحيح التكوين وغير متحيز ومعنوياً ومتجانساً زمنياً. فقد يكون الإحصاء، على سبيل المثال، سىء التكوين عندما تكون النقاط المسجلة للرقم القياسى للأسعار غير ممثلة بشكل جيد للإجمالى الوطنى، ومن ثم فإن قيمة ذلك المؤشر ستكون خاطئة. كما يمكن للإحصاء أن يكون متحيزاً فى حال قُدّر المستجوبون مبيعاتهم دون الحد الصحيح، ويمكن هنا استخدام الإحصاء المتحيز باعتباره متغيراً

تفسيرياً شرط أن يكون التحيز منتظماً على إجمالى السلسلة الزمنية. وحتى لو كان الإحصاء صحيح التكوين وغير متحيز فقد يكون غير معنوى، أى لا يمثل الظاهرة المفترض تمثيلها. فموافقات السكن التى تعتبر متغيراً تفسيرياً مهماً للمنتجات المتعلقة بالبناء، تتعلق برخص البناء التى تخضع فيما بعد لفترة زمنية محددة لبدء المباشرة. وبما أن فترة الإنجاز متغيرة وليس هناك من علاقة مباشرة بين موافقة البناء وبين البناء الفعلى، فإن هذا النمط من الإحصاء لا يستخدم بشكل مباشر.

عموماً، يجب أن تكون المعطيات معرّفة ومنظمة بواسطة قائمة تضم تعريفاً واضحاً لهذه المعطيات. ولهذه القائمة أهمية كبرى لأنها تمكننا من وضع جميع السلاسل الزمنية المستخدمة فى نظام واحد معد للتنبؤ. وهنا لا بد من الإشارة إلى التمييز بين المعطيات من ناحية كونها:

- معطيات داخلية خاصة بالمنشأة.
- معطيات خارجية مأخوذة من خارج المنشأة.

ويمكننا إجراء تجانس بين مكونات قائمة تعريف المعطيات المستخدمة بالمنشأة مع القوائم الموجودة فى أماكن أخرى. فيمكننا على سبيل المثال، من أجل المعطيات الخارجية، اللجوء إلى قوائم التعريف المعدة من قبل المعهد الوطنى للإحصاء وللدراسات الاقتصادية Insee أو الأخذ بالإحصاءات السابقة المعدة على مستوى المنشأة. وللحفاظ على خصوصية منتجات المنشأة، يجب أن تكون السلاسل الزمنية المستخدمة مزودة بقائمة مصطلحات أصلية خاصة بها.

#### ٤-٢- مصادر المعطيات:

- المنظمات المتخصصة بتجهيز البيانات الإحصائية:

تعتبر منشورات المعهد الوطنى للإحصاء وللدراسات الاقتصادية Insee والمكاتب الإقليمية التابعة لها المصدر الأساس فى الحصول على المعطيات اللازمة للتنبؤ على مستوى فرنسا، وهذه المنشورات تمكننا بسهولة من التعرف على طريقة تجهيز هذه البيانات من ناحية طريقة جمع البيانات المستخدمة ومستوى الدقة المعمول به، وكذلك دورية المعطيات المتبعة. أما المعطيات الاقتصادية والمالية الخاصة بأوروبا، فيمكن الحصول عليها من خلال المركز الفرنسى للتجارة الخارجية DAFSA، ومن خلال قواعد المعطيات المتوافرة على أقراص ليزرية مدمجة، وكذلك من خلال الاستفادة من شبكة الإنترنت. ويقوم بنك فرنسا بنشر بيانات شهرية عن المعطيات النقدية. فى حين

يقوم المجلس الوطنى للاقتراض Conseil National du Crédit بنشر الإحصاءات المالية والمصرفية بشكل سنوى. وعلى المستوى الأوروبى، يقوم المركز الأوروبى للمعطيات الإحصائية Euro stat (فى لوكسمبورغ) وكذلك OCDE بتجهيز المعطيات الاقتصادية على مستوى الدول الصناعية. كذلك هناك صندوق النقد الدولى FMI الذى يقوم بنشر الإحصاءات المالية الدولية للدول الأعضاء به وبشكل شهرى وسنوى. ونشير هنا إلى أن الكثير من المعطيات التى كانت، فى بداية العام ١٩٨٠م، غير متاحة إلا لبعض المنشآت والجهات الحكومية، أصبحت الآن متاحة عبر شبكة الإنترنت أو عبر الأقراص الليزرية المدمجة.

#### - استطلاعات الرأى حول الوضع الاقتصادى العام:

تستند هذه الاستطلاعات إلى بعض الصياغات المعدة من قبل المسئولين فى الوسط المهنى ومن قبل المنشآت والموزعين بهدف معرفة الآراء حول تطور العناصر الأساسية لنشاط المنشأة مثل السؤال عن الاتجاه العام المحتمل للإنتاج خلال الـ (٣) أو (٤) أشهر القادمة، حيث يكون للمستجوب إحدى الخيارات التالية: «+»، «=» أو «-». وهذه الإجابات الفردية يتم التعامل معها فيما بعد كونها تمثل الرأى العام المتوسط لقطاع النشاط بأكمله وليس لمنشأة واحدة. ونستخدم هنا الرصيد الجبرى فى الإجابات للنسب المئوية للصناعات التى أجابت بأحد الخيارين «+» أو «-» ويكون الفرق، على سبيل المثال، لصالح «-» فى حال كانت نسبة الإجابات السلبية أكبر من الإيجابية. ولكى نأخذ بعين الاعتبار الأهمية النسبية للمنشآت حسب حجمها، فقد تم تثقيل الإجابات تبعاً لحجم المنشأة. وهكذا فإن الإجابات المتعلقة بحركة الاتجاه العام للإنتاج المتوقع قد تم تثقيلها برقم الأعمال فى حين أن الإجابات المتعلقة بالتصدير يتم تثقيلها بأرقام التصدير.

## الفصل الحادى عشر

### تقييم واختيار طرائق التنبؤ

يعالج هذا الفصل الأخير فى جزئه الأول تقييم جودة التنبؤ. وقد يبدو هذا الموضوع مبتدلاً إلا أنه فى حقيقة الأمر ليس كذلك، فغالباً ما تواجه المنشآت صعوبات كبيرة فى إجراء قياس موضوعى لجودة التنبؤ وهذا القياس يتم عبر عدة مراحل. تتضمن المرحلة الأولى تحديد معايير محددة تسمح بتقييم دقة التنبؤ للسلعة المراد التنبؤ بحجم مبيعاتها (الفقرة ١) ومن ثم اقتراح طرائق تركيبية لتقييم جودة التنبؤ للمنشآت التى تدير عدداً كبيراً من السلع (الفقرة ٢). ونعرض فى الفقرة (٣) إجراءات تقييم جودة التنبؤ.

نعالج فى الجزء الثانى من هذا الفصل نقطة أخرى تكتسب أهمية كبرى وتتعلق بالاختيار الأفضل لطريقة التنبؤ، وذلك قبل البدء بعملية تثبيت نظام التنبؤ. وهناك عدة محاولات لتحديد طريقة الاختيار، وهى عامة ولا تتعلق بنمط محدد من المعطيات أو بقطاع معين أو مجال زمنى ما. نعرض، فى الفقرة (٤) من هذا الفصل، مختلف المحاولات المدروسة للمقارنة بين مختلف الطرائق ونضع تقييماً رقمياً لها.

الفقرة (٥) ستكون مخصصة لمقارنة المزايا والسلبيات للتقنيات الأساسية للتنبؤ وفق معايير الجودة. فالطرائق المستخدمة لا تقارن بشكل كامل فيما بينها لأنها مصممة لتطبيقات ولجالات زمنية غير متشابهة.

#### ١- قياس الجودة لتنبؤ ما:

##### ١-١- مؤشرات القياس:

هناك عدد كبير من المؤشرات<sup>(١)</sup> المستخدمة لتقييم جودة التنبؤ ونعرض هنا فقط المؤشرات الأكثر أهمية:

- الخطأ النسبى بالنسبة للفترة  $t$  ( $ER_t$ ):

ويعبر عنه على النحو التالى:

$$ER_t = \frac{|x_t - \hat{x}_t|}{x_t} \times 100$$

(١) العودة إلى ٧، ١٩٩٨، Bourbonnais et Terraza، chapitre ٧.



حيث:

$x_t$ : القيمة المحققة فى الفترة  $t$ .

$\hat{x}_t$ : القيمة المتنبأ بها للفترة  $t$ .

تسمح هذه الطريقة البسيطة والتقليدية بإعادة حساب الخطأ فى كل مرة يتوافر فيها قيم محققة جديدة تسمح بحساب الانحرافات.

- مؤشر متوسط الانحرافات المطلقة Mean Absolute Deviation:

فى حال أردنا الحصول على مؤشر تركيبى يعالج مجموعة مكونة من  $T$  فترة تنبؤ، فإننا نحسب القيمة المتوسطة لانحرافات الأخطاء بالقيمة المطلقة. وتعرّف هذه القيم فى اللحظة  $t$  على النحو التالى:

$$MAD_t = \frac{\sum_{i=t-T+1}^t |EPS_i|}{T}$$

حيث:  $EPS_t = x_t - \hat{x}_t$

- مؤشر تباين خطأ التنبؤ (Mean Squared Error, MSE):

لأخذ بعين الاعتبار للأخطاء الكبيرة فى أثناء إجراء التنبؤ مع تجاهل إشارتها، فإننا نستخدم مؤشر تباين خطأ التنبؤ المعرف فى اللحظة  $t$  بالعلاقة التالية:

$$MSE_t = \frac{\sum_{i=t-T+1}^t EPS_i^2}{T}$$

الجذر التربيعى لهذا المؤشر أى  $\sqrt{MSE}$  يشابه الانحراف المعياري لخطأ التنبؤ غير المتمركز على متوسطه. وقيمته من ثم تعطى بعداً للمخزون الاحتياطي<sup>(١)</sup> من السلعة المدروسة.

- مؤشر مقارنة الأداء لتنبؤيين، استخدام مؤشر  $U$  (Theil<sup>(٢)</sup>):

يقارن هذا المؤشر التنبؤ المستخدم فى المنشأة مع طريقة أخرى بسيطة للتنبؤ تقضى بأخذ القيمة الأخيرة المحققة باعتبارها تنبؤاً جديداً. وهو يعرف فى اللحظة  $t$  بالعلاقة التالية:

(١) العودة إلى ١٩٩٥ Bourbonnais et Vallin.

(٢) Theil ١٩٦٦.

$$U = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^{i=T-1} (CRP_{i+1} - CRR_{i+1})^2}{\sum_{i=1}^{i=T-1} (CRR_{i+1})^2}}$$

حيث:

$T$ : عدد فترات التنبؤ (مثال=١٢).

$CRP$ : التغير النسبى المتوقع (مثال=٠,٢, ٥٪).

$CRR$ : التغير النسبى الحقيقى (مثال=٠,٢, ٢٪).

يمكن تلخيص آلية تفسير قيمة المؤشر  $U$  على النحو التالى:

$U = 1$ : هذا يعنى أن التنبؤ المستخدم يعادل التنبؤ البسيط الذى يقضى باعتبار القيمة الأخيرة المحققة قيمة تنبؤية.

$U < 1$ : التنبؤ المستخدم أفضل من الطريقة الأخرى وتحسن قيمته كلما اقتربت قيمة المؤشر  $U$  من الصفر.

$U > 1$ : تقنية التنبؤ المستخدمة ليست جيدة وأكثر سوءاً من الطريقة البسيطة المشروحة سابقاً.

## ١-٢- التحيز فى التنبؤ:

هناك معيار آخر من معايير الحكم على جودة التنبؤ يتعلق بمقدار التحيز فى هذا الأخير. والتحيز فى التنبؤ يجب الكشف عنه بشكل سريع لأنه يمكن أن يولد مع مرور الزمن إما فائضاً فى المخزون من السلعة المراد التنبؤ بها أو نقصاً فيه. بالإضافة إلى المعيار AWS الذى سبق أن استعرضناه فى الفصل الثالث، وهو ما يمكننا من خلاله الكشف عن الانقطاعات فى حركة الاتجاه العام أى وجود تحيزات، سنعرض هنا اختبارين إحصائيين للغاية نفسها.

فى الاختبار الأول نعرّف ثم نقدّر نموذج الانحدار التالى:

$$x_t = a_0 + a_1 \hat{x}_t$$

حيث تمثل  $x_t$  القيمة الملاحظة فى الزمن  $t$  و  $\hat{x}_t$  القيمة المتوقعة فى الزمن  $t$ .

فإذا كان المعامل  $a_0$  مختلفاً معنوياً عن القيمة صفر، فهذا يعنى وجود تحيز ما فى التنبؤ. فى الواقع، يجب أن تكون قيمة المعامل  $a_0$  معدومة (أى غير مختلفة بشكل معنوى عن القيمة صفر) فى حال كانت التنبؤات بالمتوسط مساوية للقيم المحققة فعلاً.

المثال التالى يوضح هذه الطريقة. ليكن لدينا النموذج التالى:

$$x_t = 2.32 + 0.931 \hat{x}_t$$

(0.42)                      (9.52)

$$R^2 = 0.91$$

$$T = 18$$

(.) *t de Student*

العدد (١٨) يمثل عدد فترات التنبؤ. ويلاحظ أن المعامل  $a_0$  ليس مختلفاً بشكل معنوى عن القيمة صفر: وذلك لأن  $t_{16}^{0.05} < 0.42 = t^*$ ، ومن ثم فإن التنبؤات ليست متحيزة.

فى الاختبار الثانى نحسب النسبة ما بين الجذر التربيعى للمؤشر MSE إلى المتوسط الحسابى لأخطاء التنبؤ على فترة  $T$ :

$$\frac{\sqrt{MSE_t}}{\overline{EPS}}$$

$$\overline{EPS} = \frac{\sum_{i=1-T+1}^t EPS}{T}$$

حيث:

ومن ثم نقارن هذا المؤشر مع الجذر التربيعى لـ  $T$  المقسومة على (٢) أى يكون لدينا الاختبار التالى:

$$\frac{\sqrt{MSE_t}}{\overline{EPS}} \geq \frac{\sqrt{T}}{2}$$

فإنه من غير المحتمل وجود تحيز فى التنبؤ.

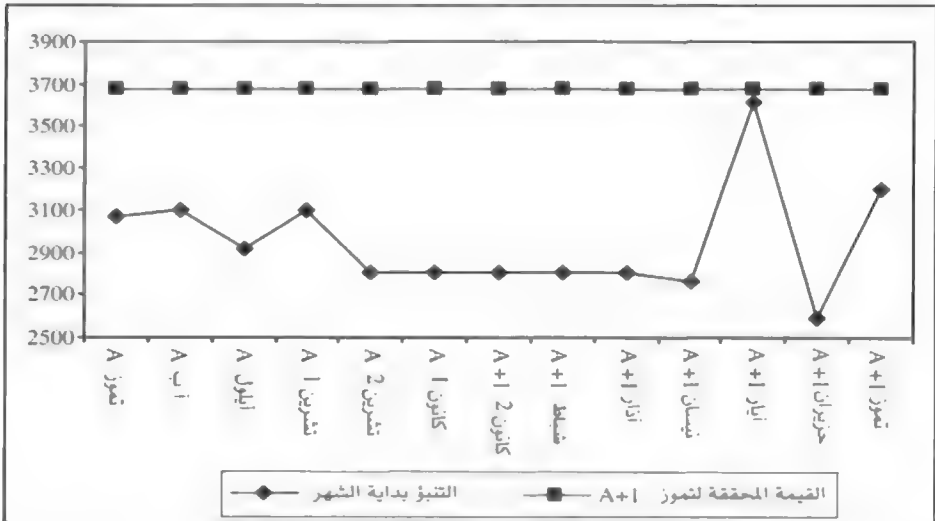
### ٣-١- تقارب التنبؤ:

يتعلق السؤال هنا بالتحسن الذى يحصل على جودة التنبؤ كلما اقتربنا من تاريخ حصول البيع الفعلى. ومن الناحية النظرية، يعتبر إجراء التنبؤ الآن للشهر القادم

أسهل من إجرائه (١٢) مرة على مدى (١٢) شهراً. فمن أجل شهر محدد. يكون هناك عدة تنبؤات «منزلة»، فهناك التنبؤ المحسوب منذ (١٢) شهراً، ثم ذلك المحسوب منذ (١١) شهراً، وهكذا إلى أن نصل إلى التنبؤ المحسوب منذ شهر واحد فقط قبل تاريخ حصول البيع المحقق للشهر المراد التنبؤ به. وهكذا فإننا خلال الـ (١٢) شهراً، يكون لدينا (١٢) تنبؤاً متتابعاً ومختلفاً للشهر نفسه. ومن ثم من المفيد تحليل آلية تطور هذه التنبؤات كلما اقتربنا من تاريخ التحقق الفعلى للبيع. والتنبؤ الشديد التقلب من فترة إلى أخرى يؤدي إلى تشويه فى العملية الإنتاجية عبر التعديلات المستمرة فى البرنامج الإنتاجى من ناحية الموارد البشرية والمواد الأولية. لذلك يجب علينا التساؤل حول تقارب التنبؤ أى درجة التحسن فيه كلما اقتربنا من تاريخ الاستحقاق الفعلى للقيمة المراد التنبؤ بها.

يبين لنا الشكل البيانى (١) آلية هذا التقارب انطلاقاً من مثال حقيقى يتعلق بمنتج للسيارات (التنبؤ بعدد السيارات المسجلة من نوع محدد). تفسير هذا التقارب هو على النحو التالى: الخط المستقيم فى أعلى الرسم يمثل أعداد السيارات المسجلة فعلاً فى شهر تموز من العام  $A + 1$  (العدد المسجل فعلاً من الموديل المعتبر هو ٢٦٨٠ سيارة)، الخط المنكسر يمثل مختلف التنبؤات المحسوبة لشهر حزيران من العام  $A + 1$ . أى تلك المحسوبة فى بداية شهر حزيران من العام  $A$  والمساوية إلى ٢٢٠٠ سيارة ومروراً بتلك المحسوبة فى بداية شهر حزيران من العام  $A + 1$  والمساوية لـ (٢٦٠٠) سيارة حتى تلك المحسوبة فى بداية تموز للعام  $A + 1$  والمساوية لـ (٣٠٧٠) سيارة.

الشكل البيانى رقم (١) آلية تحرك التنبؤات المنزلة



نلاحظ أن مختلف التنبؤات المحسوبة من تموز من العام A إلى نيسان من العام A + 1 تتباعد عن القيمة المحققة. كما نلاحظ أن التنبؤ المحسوب فى شهر أيار من العام A + 1 قريب جداً من القيمة الفعلية المحققة، ولكن سرعان ما يبتعد عن هذه القيمة فى الشهر التالى (حزيران)، وأخيراً يعود التنبؤ إلى اتجاهه الصحيح مع بداية شهر تموز من العام نفسه. يمكننا ملاحظة التالى:

- أن التنبؤ فى تموز عام A + 1 ليس أفضل جودة من التنبؤ فى تموز من العام A.
- أن المتنبأ بعد أن اقترب بشدة من القيمة الفعلية عاد وانحرف عنها مجدداً.
- أخيراً إن سعة التقلبات فى التنبؤ على مدى الأربعة أشهر الأخيرة كانت كبيرة.

هذه الظاهرة غالباً ما تحصل فى المنشأة كلما اقتربنا من تاريخ التحقق الفعلى للقيمة المتنبأ بها حيث يصبح المتنبؤ مضطرباً ويفقد بعضاً من موضوعيته ويبتعد عن القيمة التى سبق أن حصل عليها.

#### ١-٤- الكشف عن أسباب الخطأ:

يقترح بعض الباحثون (Theil, ١٩٧١, Jorgenson, ١٩٧٠, Granger et Newbold, ١٩٧٣) قياس الأهمية النسبية لكل مصدر من مصادر الخطأ التريبيعى المتوسط: تحيز، سعة أو شدة الخطأ، مركبة عشوائية بحتة.

$$E = (\bar{x} - \bar{\hat{x}})^2 + \sigma_{\hat{x}}^2 + \sigma_x^2 - 2 \rho \sigma_{\hat{x}} \sigma_x$$

حيث:

$\bar{x}$ : المتوسط الحسابى للقيم المحققة فعلاً.

$\bar{\hat{x}}$ : المتوسط الحسابى للقيم المتنبأ بها.

$\sigma_{\hat{x}}^2$ : تباين القيم المحققة فعلاً.

$\sigma_x^2$ : تباين القيم المتنبأ بها.

$\rho$ : معامل الارتباط بين القيم المحققة والقيم المتنبأ بها.

ولكى يكون الخطأ التريبيعى للتنبؤ فى حدوده الدنيا، يجب تحقق الشروط التالية:

$$\bar{x} - \bar{\hat{x}} = 0 \text{ (تنبؤ بدون تحيز) و } \sigma_{\hat{x}} = \sigma_x$$

فى حال كانت  $\rho = 1$ . فإن الانحراف المعيارى للتنبؤات والانحراف المعيارى للقيم المحققة يكونان متطابقين.

يمكننا كتابة العلاقة الأساسية السابقة بطريقة أخرى، على النحو التالى:

$$E = (\bar{x} - \bar{\hat{x}})^2 + (\sigma_{\hat{x}} - \rho \sigma_x)^2 + (1 + \rho^2) \sigma_r^2$$

$$E = EB + EA + ER$$

حيث:

$$EB = (\bar{x} - \bar{\hat{x}})^2 \text{ : المركبة المتعلقة بالتحيز.}$$

$$EA = (\sigma_{\hat{x}} - \rho \sigma_x)^2 \text{ : المركبة المتعلقة بسعة الخطأ.}$$

$$ER = (1 - \rho^2) \sigma_r^2 \text{ : المركبة العشوائية.}$$

الغاية إذن من متابعة الانحرافات فى نظام التنبؤ هى حذف الـ EB (التحيز)، ومن ثم تقليص EA (سعة الخطأ)، ثم إجراء تحسين متتالي فى جودة النموذج المستخدم للتنبؤ.

#### ١-٥- ما هو خطأ التنبؤ المسموح به؟

غالباً ما تطرح المنشآت هذا السؤال، وقد تصيفه بأشكال مختلفة مثل:

هل يعتبر خطأ التنبؤ المساوى لـ (١٥٪) مقبولاً؟

كيف نحدد هدف الجودة للتنبؤ؟

كيف نحدد بشكل مسبق النتائج المنتظر الحصول عليها؟

ترتبط الجودة المنتظرة من التنبؤ بشكل شديد بقطاع النشاط الممارس وبالصعوبة الأساسية المتعلقة بالتنبؤ لتلك السلعة (أى التباين فى السلسلة المدروسة). فعلى سبيل المثال، يعتبر خطأ التنبؤ المساوى لـ (٥٪) كبيراً بالنسبة لسلعة من منتجات الاستهلاك الكبير، فى حين يعتبر خطأ مقبولاً بالنسبة لسلعة من سلع القطاع الصناعى.

من أجل ذلك، نعرض هنا تقنية تستند إلى استخدام معامل الاختلاف الذى سبق أن تعرضنا له فى الفصل الثانى.

يقيس معامل الاختلاف CV صعوبة إجراء التنبؤ بسلعة ما. فكلما كانت قيمته مرتفعة، دل ذلك على وجود تباين كبير للسلسلة منسوباً إلى متوسطها ومن ثم صعوبة فى إجراء التنبؤ. ويجب الانتباه هنا إلى أنه من الممكن لمركبة فصلية واضحة أن تزيد من قيمة معامل الاختلاف بشكل اصطناعى، ولهذا السبب من المفضل التعامل مع السلاسل المخلصة من التأثير الفصلى أى CVS. طريقة حساب هذا المعامل هى التالية:

- تقدير السلسلة المخلصة من التأثيرات الفصلية أى CVS.
  - حساب معامل الاختلاف  $CV_{CVS}$  للسلسلة المصححة فصلياً.
- فإذا كان لدينا، على سبيل المثال،  $CV_{CVS} = 0.12$ ، فإن مجال التقلب الأساسى لمبيعات هذه السلعة يكون ضمن  $\pm 12\%$ ، ويمكن تحديد الخطأ المسموح به للتنبؤ بهذه السلعة بتقسيم القيمة السابقة على (٢) أى (٦٪)، وهذا الفرق بين القيمتين يمثل مقدار مساهمة كل من المتبأ والنموذج المستخدم.
- هذه العملية البسيطة جداً تسمح للمنشآت بوضع هدف مسبق لجودة التنبؤ الذى ترغب فيه.

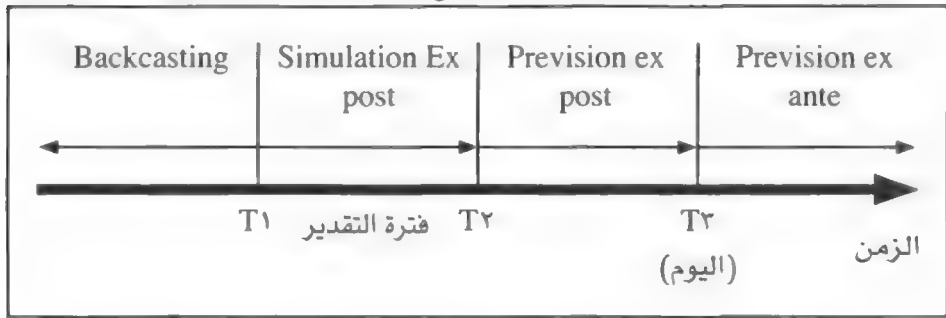
#### ٦-١- المحاكاة La simulation:

هناك وسيلة أخرى للتحقق من جودة التنبؤ وتقضى بإجراء عمليات المحاكاة على السلاسل المتبأ بها. ويجب الحذر فى تفسير نتائج المحاكاة كون هذه العمليات تتعلق بنمط المحاكاة المتبع.

#### - الأنواع المختلفة للمحاكاة:

تتوافر أنماط مختلفة من المحاكاة (انظر الرسم التوضيحي رقم ١). فى الرسم (١)، تمثل  $T1$  و  $T2$  أزمنة بداية ونهاية الفترة التى تم تقدير النموذج عليها، و  $T3$  تمثل التاريخ الحالى.

الرسم التوضيحي رقم (١) الأنواع المختلفة من المحاكاة



النوع الأول من المحاكاة هو المحاكاة التاريخية أو *Simulation ex post* وفيه يتم الأخذ بعين الاعتبار إجمالى سلسلة المبيعات التى نرغب فى التنبؤ بها، أى من الزمن

$T1$  إلى الزمن  $T2$  بالطريقة نفسها للمتغيرات التفسيرية المستخدمة. فبعد تقدير معاملات النموذج، يتم إجراء محاكاة للتنبؤات على المسار الزمنى السابق نفسه. وهذا النوع من المحاكاة يعطى قليلاً من المؤشرات حول الجودة الحقيقية المنتظرة من التنبؤ<sup>(١)</sup>. فالهدف الإحصائى لتقدير النموذج، كما هو معروف، هو تخفيض مجموع أخطاء التنبؤ إلى الحد الأدنى، فى حين أن هذا يسمح بالتحقق فقط من عمل الخوارزمية المستخدمة بشكل صحيح.

النوع الآخر من أنواع المحاكاة هو محاكاة التنبؤ *prevision ex post* ويستلزم إجراء محاكاة للنموذج بعد فترة التقدير المعتبرة، ويكون هناك جزء من معطيات السلسلة المعلومة لم يُستخدم لتقدير معالم نموذج التنبؤ، ولكن سيُستفاد منه فى مقارنة التنبؤات الناتجة من عملية التقدير مع القيم الأخرى المحققة وغير المستخدمة فى عملية التقدير. تسمح هذه الطريقة بتصنيف النتائج المنتظرة بدلالة الجودة وتشكل اختباراً حقيقياً قابلاً للتفسير.

هناك أيضاً النوع المسمى "*backcasting*" وفيه يتم التنبؤ نحو الماضى، فانطلاقاً من نموذج مقدر على الفترة من  $T1$  إلى  $T2$ ، نقوم بالتنبؤ للسنوات السابقة. والفائدة من هذه الطريقة، رغم قلة استخدامها عملياً، ليست قليلة، فهي تسمح باختبار الثباتية الديناميكية للنموذج المستخدم فى التنبؤ عندما يتحرك باتجاه معاكس نحو الوراء بدلاً من السير نحو الأمام.

أخيراً، هناك التنبؤ *ex ante* الذى يتعلق بإجراء التنبؤ لفترة غير معلومة.

## ٢- تقييم جودة التنبؤ لعدة سلع معاً:

يتم استخدام العلاقات المشروحة فى الفقرات السابقة عند التنبؤ بسلعة واحدة معينة. ولكن الكثير من المنشآت تتعامل مع عدد كبير من السلع، ومن ثم تبرز الحاجة إلى قياس جودة التنبؤ على مستوى كل السلع مجتمعة.

كما أن تقييم الخطأ على أساس النسب المئوية ليس له دائماً معنى، فالخطأ بنسبة (٥٠٪) بالنسبة لسلعة مقدرة بمبيعاتها وسطياً بـ (١٠٠٠٠٠) وحدة سنوياً أخطر من خطأ التنبؤ (٥٠٪) لسلعة لا تتجاوز مبيعاتها (٥٠) وحدة سنوياً (لواحدات قابلة للمقارنة).

(١) رغم استخدامه بشكل واسع.



## ٢-١- حساب مؤشر ترجيحي:

للتخلص من السلبيات السابقة، نقترح هنا تقنية أولية تسمح، من خلال قراءة رقم بسيط، بإعطاء مؤشر تركيبي لجودة التنبؤ.

تعتمد هذه الطريقة على حساب مجموع جداءات أخطاء التنبؤ المثقلة (المرجحة) بالحجم أو برقم الأعمال.

يوضح الجدول رقم (١) طريقة الحساب.

الجدول رقم (١) حساب مؤشر مرجح بالحجم ويرقم الأعمال (الملف: C11EX1.XLS)

سلعة ٨	سلعة ٧	سلعة ٦	سلعة ٥	سلعة ٤	سلعة ٣	سلعة ٢	سلعة ١	
٣٢٠	٧٠	٢١٠٠	٣٣٠٠	٤٣٠٩	٩٠٠	٨٦٩	٣٤٥٠	التنبؤ
٢٠٠	١٣٤	٢٩١٩	٢٧٧٤	٥٠٧٤	٩١٩	٨٥٨	٣٤٧٧	المحقق
%٦٠,٠٠	%٤٧,٧٦-	%٢٨,٠٦-	%١٨,٩٦	%١٥,٠٨-	%٢,٠٧-	%١,٢٨	%٠,٧٨-	الانحراف
%٦٠,٠٠	%٤٧,٧٦	%٢٨,٠٦	%١٨,٩٦	%١٥,٠٨	%٢,٠٧	%١,٢٨	%٠,٧٨	الانحراف المطلق
٢٢٠٠٠	١٥٠٠٠	١٧٠٠٠	٨٠٠٠	١٥٠٠٠	٢٠٠٠٠	١٦٠٠٠	١٤٠٠٠	رقم الأعمال
١٣٣٠٠	٧١٦٤	٤٧٧٠	١٥١٧	٢٢٦٢	٤١٣	٢٠٥	١٠٩	رقم الأعمال المرجح
١٢٠	٦٤	٨١٩	٥٢٦	٧٦٥	١٩	١١	٢٧	الحجم المرجح

في أعمدة الجدول السابق تظهر السلع المدارة من قبل المنشأة وعددها ثمانية وفي الأسطر تظهر خطوات الحساب. في الأسطر الخمسة الأولى لا يوجد أي مشكلة. ونعرض هنا فقط الشرح للسطرين الأخيرين:

- رقم الأعمال المرجح (السطر ٦) = رقم الأعمال (السطر ٥) X الانحراف المطلق (السطر ٤).

- الحجم المرجح (السطر ٧) = القيم المحققة (السطر ٢) X الانحراف المطلق (السطر ٤).

ومن ثم فإن مؤشر جودة التنبؤ المثقل برقم الأعمال يساوي مجموع السطر (٦) ومقسم على مجموع السطر (٥)، أي يساوي  $0.2334 = 29640 / 127000$ . إذن خطأ التنبؤ المتوسط الذي يأخذ بعين الاعتبار رقم الأعمال لكل سلعة هو (٢٣,٣٤%).

ويكون مؤشر جودة التنبؤ المثلث بالحجم مساوياً إلى مجموع السطر (٧) ومقسماً على مجموع السطر (٢). أى يكون مساوياً  $0.1437 = 2351 / 16355$ . إذن خطأ التنبؤ المتوسط الذى يأخذ بعين الاعتبار حجم كل سلعة هو (١٤,٣٧٪).

من خلال مقارنة الرقمين السابقين لمؤشرى جودة التنبؤ نستخلص جودة أقل للتنبؤات بالنسبة للسلع ذات القيمة الواحدة المرتفعة.

تسمح هذه المؤشرات المحسوبة بشكل شهرى بمتابعة ديناميكية للتحسن أو للاختلاف الحاصل فى التنبؤ.

## ٢-٢- التقييم بواسطة الرسوم البيانية:

هناك طريقة أخرى للتعرف على جودة التنبؤ من خلال استخدام الرسوم البيانية. يوضح الجدول رقم (٢) آلية إنشاء الرسم البيانى لمؤسسة تدير (١٨) سلعة ويتضمن العناصر التالية:

- تصنيف تصاعدى للسلع حسب الخطأ النسبى للتنبؤ (٪) بالقيمة المطلقة (العمود ٤).
- حساب الوزن النسبى للسلعة المنسوب إلى إجمالى مبيعات المنشأة (الحجم المحقق فعلاً من مبيعات السلعة مقسوماً على إجمالى حجم المبيعات).
- المتراكم من الأوزان النسبية المرجحة (كنسبة مئوية ٪، العمود ٦).

نمثل فى الشكل البيانى رقم (٢) النسب المئوية لأخطاء التنبؤ (العمود ٤) على محور السينات والمتراكم من الأوزان المرجحة (العمود ٦) على محور العيّنات.

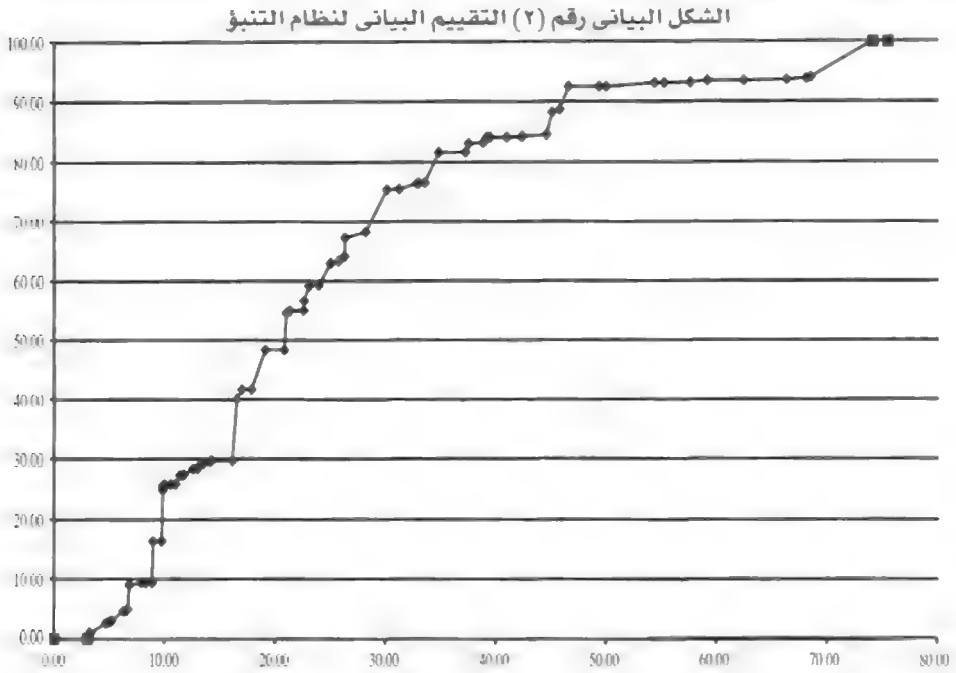
التفسير يكون على النحو التالى:

- كلما كان المنحنى متوضّعاً إلى اليسار وينمو بسرعة (شكل محدب)، كانت جودة التنبؤ أفضل.
- للحكم على الجودة الإجمالية، يكفى النظر مثلاً إلى القيمة (١٠) والقيمة (٢٠) على محور السينات اللتين توافقان تقريباً (٢٥٪) و(٤٩٪) من حجم المبيعات المعالج. فمن أجل (٢٥٪) من الحجم المتنبأ به، يكون خطأ التنبؤ أقل أو يساوى (١٠٪)، ومن أجل (٤٩٪) (النصف تقريباً) من الحجم المعالج، يكون خطأ التنبؤ أقل أو يساوى (٢٠٪).

تفيد هذه التقنية فى تجنب إعطاء أهمية كبيرة لخطأ معزول حتى لو كان كبيراً جداً. بالإضافة إلى ذلك، يمكن تطبيقها على المعطيات حسب الحجم (بالوحدات)، كما هو الحال فى المثال المستخدم، وحسب القيمة عندما يكون للسلع وحدات قياس غير متجانسة.

الجدول رقم (٢) عناصر إنشاء الرسم البياني لتقييم الجودة (الملف: C11EX2.XLS)

السلعة العمود ١	القيمة الفعلية العمود ٢	المتنبأ به العمود ٣	% للانحراف العمود ٤	تراكم المبيعات العمود ٥	% من المبيعات الإجمالية العمود ٦
سلعة ١	٤٠	٤٠	٠,٠٠	٤٠	٠,٠١
سلعة ٢	٣٣	٣٤	٣,٠٢	٧٣	٠,٠١
سلعة ٣	٥٨٧٢	٥٦٨٥	٣,١٨	٥٩٤٥	٠,٨٦
سلعة ٤	٩١	٨٨	٣,٣٠	٦٠٣٦	٠,٨٧
سلعة ٥	١١٠٢١	١٠٥٠١	٤,٧٢	١٧٠٥٧	٢,٤٦
سلعة ٦	١٦٨٤	١٥٩٩	٥,٠٥	١٨٧٤١	٢,٧٠
...	...	...	...	...	...
...	...	...	...	...	...
سلعة ٧٢	٤١٤٨	٦٤٠٤	٥٤,٣٩	٦٤٥٤٨٨	٩٣,٠٥
سلعة ٧٣	٣٨	١٧	٥٥,٢٦	٦٤٥٥٢٦	٩٣,٠٦
سلعة ٧٤	٦٨٧	٢٩١	٥٧,٦٤	٦٤٦٢١٣	٩٣,١٦
سلعة ٧٥	١٨٥٣	٢٩٥٠	٥٩,٢٠	٦٤٨٠٦٦	٩٣,٤٣
سلعة ٧٦	٤٨	٧٨	٦٢,٥٠	٦٤٨١١٤	٩٣,٤٣
سلعة ٧٧	٨٠٠	١٣٣١	٦٦,٣٨	٦٤٨٩١٤	٩٣,٥٥
سلعة ٧٨	١٥١٣	٢٥٤٤	٦٨,١٤	٦٥٠٤٢٧	٩٣,٧٧
سلعة ٧٩	١٣٩٧	٢١٨٦	٦٨,٥٤	٦٥١٧٢٤	٩٣,٩٥
سلعة ٨٠	٤١٧٧٠	٧٢٧٥٩	٧٤,١٩	٦٩٣٤٩٤	٩٩,٩٧
سلعة ٨١	١٨٠	٤٤	٧٥,٥٦	٦٩٣٦٧٤	١٠٠,٠٠



لقد اعتبرنا فى هذا المثال القيمة المطلقة لأخطاء التنبؤ على اعتبار الأهمية المتماثلة للأخطاء الإيجابية والسلبية. ولكن فى بعض المنشآت يكون هناك أهمية أكبر للانقطاع فى إمدادات المخزون، أى أهمية أكبر لأخطاء التنبؤ الإيجابية (القيمة المحققة للبيع < القيمة المتنبأ بها) ولذلك فإنه فى هذه الحالة من الممكن إنشاء رسمين بيانيين، واحد لأخطاء التنبؤ الموجبة والآخر لأخطاء التنبؤ السالبة.

### ٣- إجراءات التقييم:

#### ٣-١- فترة الاختبار:

لا يتم الحكم على نظام التنبؤ من مجرد محاولته للمرة الأولى. وسواء كانت النتيجة إيجابية أم سلبية، فإنه من الضرورى إجراء مزيد من التجارب لاتخاذ القرار إزاء فعالية هذا النظام. وهذه التجارب المتعددة تفيد فى تجاوز مرحلة التطابق أو التصادف حتى الوصول إلى مرحلة المعنوية الإحصائية لدرجة من الدقة حقيقية.

وفترة الاختبار يجب أن لا تكون طويلة جداً بحيث تغطى فترة التنبؤ المرغوب فيها. الحل لهذه المسألة يتلخص فى إجراء الاختبار على الفترة التى تمثل ثلاث مرات مجال التنبؤ. على سبيل المثال، يمكننا، من أجل التنبؤ الفصلى الذى يصدر كل ثلاثة أشهر، حساب الانحرافات خلال فترة (١٨) شهراً، وهذا يعنى اختبار ستة إصدارات من إصدارات التنبؤ.

وفى مثال آخر يتعلق التنبؤ لمدة ستة أشهر بقيم شهرية ويتم تحديثه فصلياً، نقترح الأسلوب التالى لفترة الاختبار: نجرى كل ثلاثة أشهر، تقييماً لجودة التنبؤ على المستوى الفردى لكل سلعة (الفقرة ١). وعلى المستوى التركيبى لمجموع السلع (الفقرة ٢). وذلك باتباع خطوات شهرية وفصلية (فقد يكون التنبؤ غير مناسب على المستوى الشهرى ومناسباً على المستوى الفصلى).

يجب الحذر من التفسير السريع لأية نتيجة إيجابية، فقد يكون لسلسلة زمنية خام معامل اختلاف يساوى (٢٠٪) (الانحراف المياري المعبر عنه كنسبة مئوية من المتوسط)، ويصبح هذا المعامل (٨٪) بعد تخلص السلسلة من التأثير الفصلى، ومن ثم فإن التنبؤ بها مع وجود خطأ تربيعى متوسط يعادل (٧٪) يعنى أن أداء التنبؤ ليس كما يجب. إذن لا يقاس إسهام أو جودة طريقة التنبؤ بشكل فوري، فقد يكون هناك تأثير لبعض مكونات السلسلة على نتائج التنبؤ ومن ثم لا بد من فصل هذه المكونات، ومن ثم إجراء التنبؤ. ففى المثال السابق نجد أن دقة طريقة التنبؤ المستخدمة بعد نزع المركبة الفصلية ضعيفة جداً.

بالإضافة إلى ذلك، يجب ألا تقاس جودة التنبؤ بشكل مستمر، فقد يكون التنبؤ فى فترة ما خاطئاً ويشير إلى الانخفاض فى حصة مبيعات السوق، فى حين يشهد السوق نمواً متسارعاً ويعود ليصبح دقيقاً خلال الأشهر الثلاثة التالية حيث تنخفض الأرقام الحقيقية للمبيعات. يمكننا القول إذن إن التنبؤ كان جيداً من خلال التشكيك باستمرارية التعديل (أى النمو) الذى حصل على مركبة الاتجاه العام ومن خلال الدور المنظم الذى لعبه.

### ٣-٢- المقارنة بين التنبؤات:

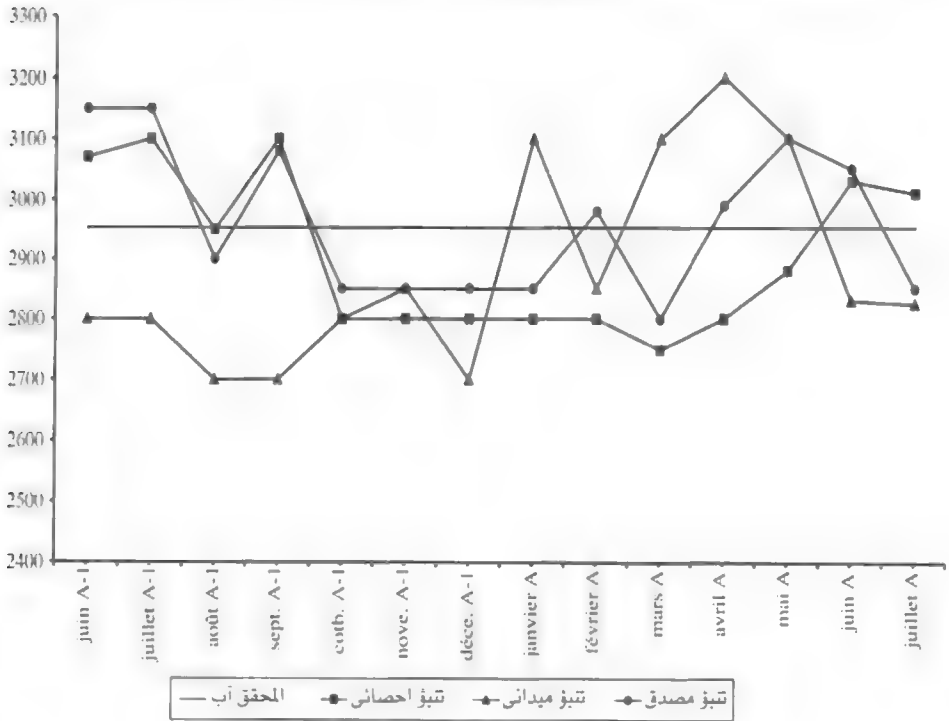
هناك عدة إمكانيات للمقارنة بين التنبؤات، والهدف هو محاولة الوصول بواسطة التنبؤ إلى القيم الحقيقية للمبيعات أو المقارنة بين عدة طرائق مختلفة للتنبؤ لمعرفة الأفضل منها.

لنأخذ المثال التالى المتعلق بمنشأة تستخدم ثلاثة مصادر مختلفة لإجراء التنبؤ بمبيعاتها.

- التنبؤ الإحصائى باستخدام نموذج رياضى للتنبؤ.
  - التنبؤ الميدانى الناتج عن استخدام ودمج تنبؤات العاملين بالسوق.
  - التنبؤ المصادق عليه عبر فريق متخصص (فريق التنبؤ)، (الفصل ١ و ١٠).
- ويمكننا هنا أن نعرض الرسم البيانى لنتائج الطرائق المختلفة للتنبؤ للفترة الزمنية نفسها.

فمن أجل التنبؤ لشهر آب من العام A، يبين الشكل البيانى رقم (٢) نتائج التنبؤ المنزلق على مدى (١٤) شهراً.

الشكل البيانى رقم (٢) مقارنة بين القيمة المحققة وثلاثة أنواع من التنبؤات (إحصائى، ميدانى، مصدق)  
(الملف: C11EX3.XLS)



نلاحظ أن نتائج التنبؤ «الميدانى» بقيت على مدى (١٢) شهراً مقدرة بشكل أقل من القيمة الحقيقية، ثم بقيت ثابتة نسبياً حتى الاقتراب من شهر آب: إذ اعتباراً منه تظهر تقلبات كبيرة. أما التنبؤ الإحصائى فإنه يتطور بشكل تدريجى إلى حد التقارب مع القيمة الحقيقية. وبخصوص التنبؤ المصادق عليه، فإنه يتوضع غالباً ما بين التنبؤ الإحصائى والتنبؤ الميدانى.

### ٣-٣- بعض المؤشرات المهمة:

فى أنظمة التنبؤ المستندة إلى عدد كبير من المنتجات يجب أن يكون لإدارى هذه الأنظمة القدرة على تمييز بعض المؤشرات غير الطبيعية التى تظهر فى أثناء تنفيذ البرنامج التى تستدعى منهم التدخل بشكل سريع لمعالجتها. نقترح هنا بعض المؤشرات العملية المتعلقة بنظام تنبؤ شهرى للمبيعات.

نعتبر التنبؤ المحتفظ به (مجموعة التنبؤات المتتابعة والمخزنة) والمحقق من صحته من قبل المستخدم كأساس للمقارنة، ويكون عدد التنبؤات المحتفظ بها مساوياً لـ  $T = 12$ . ومن ثم فإن كل المؤشرات يتم حسابها على فترات التنبؤ الـ (١٢) الأخيرة.

#### - الكشف عن القيم الشاذة وحذفها:

فى حال وجود أية قيمة من قيم السلسلة الزمنية المصححة من التقلبات الفصلية CVS خارج المجال  $\pm 2\sigma$  فذلك يدل على احتمال كون تلك القيمة شاذة أو غير طبيعية. (تمثل الانحراف المعيارى للسلسلة CVS).

#### - الارتفاع غير الطبيعى لخطأ التنبؤ:

فى حال تحقق  $|EPS| / |MAD| > 3$  فذلك يشير إلى ارتفاع غير طبيعى فى خطأ التنبؤ.

#### - الانقطاع فى حركة الاتجاه العام:

هنا نستخدم المؤشر  $SUMEPS$  (مجموع الأخطاء التراكمية، العودة إلى الفصل الثالث).

فإذا تحقق أن  $|SUMEPS| / |MAD| > 3$  فذلك يوحى باحتمال وجود بعض التحيز.

أو إذا استخدمنا الاختبار الإحصائى التالى وكان لدينا:  $\frac{\sqrt{MSE}}{EPS} < \frac{\sqrt{T}}{2}$  فإن ذلك أيضاً مؤشر للتحيز.

#### - فعالية نموذج التنبؤ:

هنا نستخدم المؤشر  $MSE$  (الخطأ التربيعى المتوسط).

إذا تحقق أن  $MSE$  أكبر من تباين سلسلة المبيعات المصححة من التقلبات الفصلية  $(\sigma_p^2)$ ، فإن ذلك يشير إلى عدم فعالية نموذج التنبؤ المستخدم، وذلك لأن تباين خطأ التنبؤ أكبر من التباين الأساسى للسلسلة المراد التنبؤ بها.

إذن يتوجب على القائم على عملية التنبؤ، عند كل إصدار جديد من التنبؤات، أن يولى أهمية خاصة للسلع التى تُظهر انحرافاً فى واحدة أو أكثر من المؤشرات السابقة.

### ٤- مقارنة وتوفيق بين عدة طرائق للتنبؤ:

#### ٤-١- مقارنة طرائق التنبؤ:

هناك عدة دراسات تتعلق بهذا الموضوع، وبشكل خاص فى الولايات المتحدة. فقد قام V.A.Mabert (١٩٧٨) بإجراء مقارنة على مدى عدة سنوات للتنبؤات المعدة من قبل إدارى المنشآت على أساس حدسى وباستخدام طرائق تنبؤ رياضية. بينت هذه الدراسة أفضلية للطرائق الأخيرة على استخدام التنبؤ الحدسى، وذلك على مدى عدة سنوات. هذه النتيجة لصالح طرائق التنبؤ الكمية كانت قد دُعمت بعدة دراسات أخرى فيما بعد (Carbone et Gorr, ١٩٨٥, Armstrong, ١٩٨٦). بالمقابل فإن هناك استخداماً مستمراً لطرائق التنبؤ الحدسية المستندة إلى أحكام إدارى المنشأة وعلى فريق البيع أكثر من الطرائق الكمية (Dalrymple, ١٩٨٧, Mentzer et Cox, ١٩٨٤). وهذه الدراسات الأخيرة بينت أن سبب عدم استخدام الطرائق الكمية يعود إلى عدم التعود فى التعامل مع هذه الطرائق.

وفى دراسة أخرى شملت مئات من كبرى المنشآت الأمريكية، قام Manrod et Sanders (١٩٩٤) بتحليل التقنيات المستخدمة فى التنبؤ، ولقد تبين لهم أن معظم التقنيات المستخدمة فى الطرائق الكمية معروفة من قبل المنشآت، حيث إن (٦٪) فقط



من المستجوبين لم يكونوا يعلمون بالصلق الأسى أو بالانحدار. بالمقابل فإن موضوع توزيع السلسلة إلى مكوناتها الأساسية كان مجهولاً من قبل (٢٥٪) من المستجوبين وقراءة نصف المستجوبين يجهلون طريقة بوكس وجانكينز. وفى جراء ذلك، كان هناك استخدام كبير للمفاهيم المتعلقة بمركبة الاتجاه العام وللوسط المتحرك وللصلق والانحدار، ولكنه استخدام أقل لطريقة بوكس وجانكينز (٢٪ فقط من المنشآت). ولربما يعود السبب فى ذلك إلى عدم الرضا عن هذه الطريقة والذى أشار إليه (٤٨،٥٪) من المنشآت مقابل (٢٠٪) تقريباً بالنسبة للتنبؤ الحدسى، وللاستخدام تقنيات الانحدار. وقد تبين من هذه الدراسة أيضاً أن الأسباب الأساسية التى أشار إليها المستجوبون لصالح استخدام التقنيات الكمية تتمثل فى إدخال البيئة الخارجية (٢٨،٩٪) والمعطيات المتعلقة بالمنتج (٢٩،٨٪)، وكذلك الأخذ بعين الاعتبار للتجربة السابقة (٢٥،٩٪). أما بخصوص طرائق التنبؤ الحدسية، فقد أشارت الدراسة إلى أن أسباب اللجوء إليها يعود إلى سهولة استخدامها وإلى تكلفتها المنخفضة وإلى صعوبة الحصول على المعطيات اللازمة لاستخدام الطرائق الكمية.

وبخصوص طرائق التقدير الكمية فإن هناك جدلاً داخل هذه الطرائق يتعلق بالجودة المتعلقة باستخدام، التحليل الخارجى، والتحليل الداخلى فى هذه الطرائق. وهذا النقاش قديم، وفى عام ١٩٥١ أشار Christ إلى أنه فى حال حصول تقلبات هيكلية فإن النماذج الاقتصادية القياسية ليست أفضل من تحليل السلاسل الزمنية. وفى دراسة أخرى فى العام ١٩٧٢، اعتبر Cooper (١٩٧٢) أيضاً أن النماذج الاقتصادية القياسية ليست عموماً أفضل من التحليل الميكانيكى الصرف (تحليل داخلى). خلصت دراسات (Sanders et Manrodt, ١٩٩٤, Lee et al., ١٩٩٢, Maclaughlin, ١٩٧٥) إلى نتيجة مفادها أن الطرائق الداخلية أفضل أداءً على المدى القصير وبشكل خاص تقنيات الصقل الأسى عندما يكون مجال التنبؤ محصوراً بين (١) و(٦) أشهر، أما بالنسبة للانحدار والنماذج الاقتصادية القياسية فهى تبدو أفضل أداءً للمجالات الزمنية الأطول من سنة.

بالخلاصة، يجب الإشارة إلى أن هذه الدراسات المقارنة قابلة للنقاش. فالتنبؤ الحدسى ليس تنبؤاً منافساً وإنما هو تنبؤ متمم للتنبؤ الكمي الذى يصبح أفضل أداءً فى حال الأخذ بعين الاعتبار للتنبؤ الحدسى. بالإضافة إلى ذلك، فإن عينات هذه الاختبارات محدودة ومقارنة النتائج ليست منسوبة إلى العينات. أخيراً، فإن تحليل السلاسل الزمنية الذى يختص بشكل أساسى بالمدى القصير وبمساعدة المعطيات الاقتصادية الجزئية ومعطيات المنشأة الشهرية يمكن أن يكون فى موقع تنافسى مع

النماذج الاقتصادية الكلية المستخدمة بشكل أساسى للمدى المتوسط والطويل من خلال المعطيات الاقتصادية الكلية الفصلية أو السنوية أو معطيات قطاع النشاط. إذن يجب أن يكون المستخدم حذراً فى لجوئه إلى الدراسات المقارنة عند اختياره لطريقة التنبؤ. وهذا الاختيار يرتبط بشكل أساس بقطاع النشاط الممارس لدى المنشأة وبمجال التنبؤ المراد.

#### ٤-٢- توفيق بين طرائق التنبؤ:

من خلال قراءة الفقرة السابقة يتضح لنا عدم وجود طريقة مثالية للتنبؤ. وانطلاقاً من ذلك، فقد اقترح (Granger ١٩٨٩) عدم استخدام طريقة واحدة للتنبؤ وإنما توفيقاً من الطرائق المتاحة.

لنأخذ مثلاً يتعلق بالمتنبئ المتردد، فى جراء نتائج الاختبارات، فى استخدام الصقل الأسى أو نموذج تفسيرى ما. وهو لا يستطيع الاستخلاص لأفضلية طريقة على أخرى، ويقرر استخدام التنبؤ الناتج عن توفيق لنتائج الطريقتين:

$$\text{التنبؤ التوفيقى} = \frac{1}{2} (\text{التنبؤ بالصقل}) + \frac{1}{2} (\text{التنبؤ بالنموذج التفسيرى})$$

هنا تم استخدام معامل التثقل لكلتا الطريقتين  $\frac{1}{2}$  بشكل حدسى ولنحاول الآن البحث عن كيفية تحديده بشكل أمثل.

العلاقة العامة المستخدمة هى التالية:

$$PC = k P1 + (1-k) P2 \quad \text{حيث } 0 < k < 1$$

PC: التنبؤ التوفيقى.

P1: التنبؤ الناتج من الطريقة الأولى.

P2: التنبؤ الناتج من الطريقة الثانية.

k: معامل التثقل.

ومن ثم فإن خطأ التنبؤ التوفيقى يساوى:

$$EPC = k EP1 + (1-K) EP2$$

ويعطى تباين خطأ التنبؤ بالعلاقة التالية:

$$\text{Var} (EPC) = k^2 \text{Var} (EP1) + (1-k)^2 \text{Var} (EP2) + 2(1-k) k \text{Cov} (EP1, EP2)$$

حيث  $Cov (EP1, EP2)$  يمثل تمام التباين (التباين المشترك) بين أخطاء التنبؤ للطريقتين.

وبالبحث عن تصغير تباين خطأ التنبؤ إلى الحد الأدنى، نحصل على النتيجة التالية عبر عمليات اشتقاق جزئى بالنسبة للمعامل  $k$ :

$$k = \frac{Var (EP2) - Cov (EP1, EP2)}{Var (EP1) + (Var2) - 2 Cov (EP1, EP2)}$$

وفى حال عدم وجود ارتباط بين أخطاء التنبؤ الناتجة من الطريقتين، تصبح العلاقة السابقة على النحو التالى:

$$k = \frac{Var (EP2)}{Var (EP1) + (Var2)}$$

وبأخذنا للقيمة  $k$  الناتجة من إحدى العلاقتين السابقتين، يُبرهن<sup>(١)</sup> على أن تباين خطأ التنبؤ التوفيقى أقل من التباينات الناتجة من  $P1$  و  $P2$ .

رغم أن هذه الطريقة تبدو فكرياً مشوقة، إلا أنها تبقى صعبة الاستخدام فى المجال الصناعى عندما يكون هناك معالجة لعدد كبير من سلاسل المبيعات.

## ٥- اختيار تقنية التنبؤ:

إن وجود طرائق متعددة للتنبؤ تجعل القائم على التنبؤ فى حيرة من أمره وخصوصاً أن بعض هذه الطرائق مكلفة. ولكن بشكل عام فإن التقنية الملائمة تتعلق بالهدف المنشود من التنبؤ وينمط نشاط المنشأة.

### ٥-١- معايير الانتقاء:

هناك عدة عوامل يجب أخذها بعين الاعتبار عندما يكون هناك قرار بتثبيت نظام للتنبؤ:

- الهدف المراد من التنبؤ: تكون طريقة التنبؤ مختلفة تبعاً للهدف المراد منه. فطرح منتج جديد فى السوق يستلزم تقديراً إجمالياً للسوق، فى حين أن التنبؤ بتأثير إستراتيجية تسويقية ما يستلزم نظام تنبؤ مميز يأخذ بعين الاعتبار العوامل المحتواة

(١) Granger, ١٩٨٩.

فى هذه الإستراتيجية. وبالطريقة نفسها، فإن عمليات التمديد الخارجى التى تحدد ما سيكون عليه المستقبل فى حال عدم إجراء أى تغيير من قبل المنشأة يكون غير كاف لإنجاز مخطط تحرك للمنشأة. إذن يوضح هذا المعيار الدقة والقوة (المرتبطة بدرجة التعقيد) للتقنية الممكن استخدامها وكذلك يوجه نحو الخيار المناسب.

- نمط المعطيات: إن الخيار بين معطيات المنشأة أو معطيات السوق وكذلك دورية المعطيات ودرجة دقتها تعتبر جميعها عناصر متغيرة تتعلق بنمط الطريقة المستخدمة للتنبؤ. فطرائق التنبؤ وآلية المعالجة تختلف تبعاً لنمط المعطيات (مخلصة من التقلبات الفصلية، شهرية، فصلية، .... إلخ).

- المجال الزمنى للتنبؤ: يتعلق المجال الزمنى للتنبؤ بدورية المعطيات ويطول السلسلة الزمنية المستخدمة. وفى معظم الحالات، يعتبر المجال الزمنى شرطاً للنظام ويرتبط بالمعلومات المتاحة.

- التكلفة: عادة ما تحدد المنشأة حصة فى الميزانية مخصصة للدراسات المتعلقة بالتنبؤ. ومن ثم فإن نظام التنبؤ الواجب اختياره يجب أن يتفق مع الحصة المحجوزة له. مع العلم بأن التكلفة تتغير بشكل واضح مع التقنية المستخدمة.

- درجة التعقيد: عادة ما يتعلق اختيار المنشأة لنظام التنبؤ بدرجة الصعوبة لاستثمار هذا النظام أو لاستخدامه. ويرتبط هذا المعيار بالعنصر السابق المتعلق بالتكلفة.

## ٥-٢- الخيارات الأساسية الثلاثة:

بهدف التبسيط، يمكننا أن نعرف هنا ثلاث فئات من الطرائق الإرشادية المختلفة:

- التقنيات النوعية: وتستخدم عندما تكون المعطيات نادرة أو ذات طبيعة نوعية. وتستدعى حكماً حديسياً بقصد تحويل المعطيات النوعية إلى تقديرات كمية.
- التمديد الخارجى للسلاسل الزمنية: وهذا يعنى عملية إسقاط للمسارات الزمنية للسلاسل المدروسة التى يجب أن تكون متاحة ويمكن استثمارها على عدة سنوات سابقة.

- النماذج التفسيرية: عندما نستطيع تحديد الارتباطات الزمنية بين السلسلة المراد التنبؤ بها وبين عناصر تفسيرية أخرى، فإننا نستخدم نموذجاً اقتصادياً قياسيياً. وتعتبر هذه الطريقة الأفضل للتنبؤ بالتقلبات فى الحالة الاقتصادية العامة وكذلك فى حال الأخذ بعين الاعتبار للسياسة التسويقية.

## ٥-٣- تبديل التقنية المستخدمة تبعاً لمراحل دورة حياة المنتج:

وفقاً لمقالة Chambers *et al.* (١٩٧٧) فإن تقنية التنبؤ المستخدمة تتغير أول بأول مع مراحل حياة المنتج ضمن قطاع النشاط نفسه والمنشأة نفسها. يعرض الجدول رقم (٣) هذا التبديل مع الزمن.

الجدول رقم (٣) تبديل طريقة التنبؤ تبعاً لمرحلة حياة المنتج

مرحلة حياة المنتج	التصور (التطوير) I	طرح المنتج II	النمو III	الإشباع IV
هدف التنبؤ	دراسة خصائص المنتج	السياسة التسعيرية	المبيعات	المبيعات
	الإستراتيجية طويلة الأمد	التوزيع	تخطيط الإنتاج	الحملات الترويجية والإعلانية
	الإنتاج	حجم الإنتاج		السعر
الطرائق الممكنة	طريقة دلفى	دراسات السوق	نموذج سببى بسيط	نموذج داخلى أو تمديد خارجى
	طريقة التشابه مع السابق	طريقة التشابه مع السابق		
	جدول تبادل بين الصناعات		منحنى منطقى	نموذج سببى
	دراسة السوق		دراسة السوق	تحليل الدورة الاقتصادية
	استطلاعات الرأى			دراسة السوق
	نموذج سببى على جزء من السوق			

يتعلق اختيار الطريقة في المرحلة I بوضع المنتج. فإذا كان منتجاً جديداً لسوق موجود سابقاً، فإنه يتم استخدام الطرائق النوعية: دلفي Delphi، دراسات السوق، نظام التنبؤ على أساس استطلاعات رأي المستهلكين. فاستخدام الطرائق الكمية يحتاج إلى قواعد بيانات (المبيعات السابقة) والتي هي غير متوافرة في هذه الحالة.

الأسئلة في المرحلة II تكون من النمط التالي: ماذا يجب أن تكون إستراتيجيتنا التسويقية؟ ما الطاقة التشغيلية الضرورية؟ للإجابة عن هذه الأسئلة، فإننا لا نمتلك معلومات إضافية عن تلك المتاحة في المرحلة I، ومن ثم فإن التقنيات هي تقريباً نفسها مع إمكانية أكثر لاستخدام الطرائق الإحصائية التي تصبح شيئاً فشيئاً ممكنة الاستخدام نتيجة القيم الحقيقية الأولية للبيع.

المرحلة III تبدو الأصعب كونها تقضى بالتنبؤ لمرحلة الانتقال من المرحلة الحالية إلى المرحلة التي سيبدأ المنتج عندها بتحقيق نمو أقل. ومن خلال قيم المبيعات السابقة وتحليل الانحرافات يتكون لدينا قاعدة للبيانات تفيد في استخدام طرائق كمية للتنبؤ. تشمل هذه الأخيرة إنشاء نموذج تفسيري أو استخدام المنحنى المنطقي (المنحنى على شكل S) مع الاستفادة دائماً من دراسات السوق و يحظر استخدام الطرائق الداخلية في هذه المرحلة حيث لا يمكننا من خلال عمليات التمديد الخارجى توقع التغيرات في مركبة الاتجاه العام.

أخيراً عندما يصل المنتج إلى مرحلة الإشباع، فإن ثباته يسمح باستخدام عدد كبير من الطرائق النوعية أو الكمية، وذلك تبعاً للهدف المتعلق بالمجال الزمنى والدقة وبالتكلفة.

نعرض في الجدول رقم (٤) طرائق<sup>(١)</sup> التنبؤ وخصائصها المتعلقة بالدقة وبالمجال الزمنى وبفترة تنفيذها، ... إلخ. ولا يعتبر هذا الجدول التركيبي شاملاً للعملية التنبؤية وقد يشتمل على بعض الأخطاء التقريبية حول الدقة والمهلة الزمنية، ويفيد فى وضع التقنيات المستخدمة الواحدة تلو الأخرى وفقاً لتدرجهم حسب بعض المعايير.

(١) هذا الجدول مأخوذ من مقالة Chambers المشار إليها سابقاً.

الجدول رقم (٤) طرائق وخصائص

الطريقة	الدقة قصير الأجل ١٢-٠ شهر	الدقة متوسط الأجل ١٢ شهر	الدقة طويل الأجل ٣٠ سنة	التعرف على تقلبات الحالة الاقتصادية	المهلة الزمنية	المعطيات الضرورية	انماط التطبيقات	استخدام الحاسب
دلفى	+	++	+++	نعم	٦-٢ شهر	تصميم استبانة، عينات استطلاعية	تنبؤ بسوق جديد. طرح منتج	لا
دراسة السوق	+++	++	++	نعم	مثله	دراسة مستتديه تتعلق بالسوق	تنبؤ بسوق جديد. بالمبيعات. بالخيارات الإستراتيجية	لا
تشابه مع السابق	++	+	-	صعب	أسبوعان	سلسلة زمنية لعدة منتجات ولسنوات عدة	تنبؤ بسوق جديد	لا
صقل أسى	+	-	-	لا	يوم واحد	سلسلة زمنية ٣ ل سنوات	تنبؤ بالمبيعات	نعم
بوكس جانكينز	++	-	-	-	لا	يوم واحد	تنبؤ بالمبيعات	نعم
نموذج انحدار	+++	++	-	نعم	شهر واحد	سلسلة زمنية لعدة سنوات	تنبؤ بالمبيعات. بالسوق. تثبيت سياسة تسويقية	نعم
جدول التبادل بين الصناعات	غير قابل للتطبيق	++	+	نعم	٥ أشهر	كميات كبيرة من المعلومات مأخوذة من الحسابات القومية	تنبؤ بأرقام الأعمال لأصناف المنتج أو للتقسيمات حسب القطاعات	نعم
نموذج قياسي بمعاملات أنية	معقد جداً	+++	++	نعم	٦ أشهر	سلسلة زمنية نصف سنوية أو سنوية على عدد من السنوات	تنبؤ بالسوق	نعم

## خاتمة

لقد عرضنا فى هذا الكتاب مجموعة من الطرائق والتطبيقات الخاصة بموضوع التنبؤ. وقد تقدم للمسؤولين عن إعداد التنبؤ فى المنشأة قاعدة أساسية للتفكير واتخاذ القرار بخصوص نظام التنبؤ المناسب.

ونحن هنا لا ندعى الشمولية فى الطرح وخصوصاً بالنسبة لموضوع شديد الاتساع وهو التنبؤ بالمبيعات، وفى الوقت نفسه لم نقلل من أهمية هذا الطرح. بالمقابل فإن الصعوبات المرتبطة بالظواهر الاقتصادية والتنوع فى القطاعات لم تسمح لنا بالوصول إلى طريقة واحدة للتنبؤ تفى بجميع الاحتياجات. ولهذا السبب، فإن الأمثلة المستخلصة من حالات حقيقية للمنشأة تختلف فيما بينها بشكل واضح وتستلزم من ثم تقنيات مختلفة للمعالجة والحصول على التنبؤات المطلوبة، وهذا يبرهن على أن كل حالة تشكل جزءاً من فضاء متعدد الأوجه ويستلزم طريقة خاصة مناسبة له.

إن الانتشار الواسع لوسائل المعالجة الآلية للبيانات سواء من ناحية قدرتها أو من ناحية الوصول السهل لاستخدامها سهّل كثيراً من عمل القائم على التنبؤ وأتاح له إجراء الحسابات الضرورية بسرعة كبيرة وفعالة وبأقل كلفة. هذه الثورة فى المعلوماتية أدت إلى تغيير فى طريقة التفكير لدى القائمين على التنبؤ، فقد أصبح التنبؤ الحدسى متماً أو مكملًا للتنبؤ المستند إلى طرائق علمية واستدعى إجراء مراجعة بالمعارف والعادات الموجودة سابقاً.

تبين لنا. من خلال بعض الأمثلة التطبيقية البسيطة، مقدار السهولة فى استخدام أنظمة كمية للتنبؤ. وهذا الاستخدام ليس أصعب من استخدام الوسائل البسيطة لمعالجة البيانات الإحصائية.

يتوافر حالياً الكثير من البرمجيات الجاهزة المخصصة لإجراء التنبؤ بالمبيعات أو تلك الأكثر تكاملاً وتسمح بالوصول إلى الحل الأمثل لكل مراحل العملية اللوجستية فى المنشأة. ويستلزم استخدام هذه البرمجيات معرفة جيدة بأدواتها وحدا أدنى من المعلومات التى عرضناها فى هذا الكتاب.

فى حال أدى إسهامنا فى هذا الكتاب إلى تحسين الإجراءات المتعلقة باتخاذ القرارات داخل المنشأة، فإننا نكون بذلك قد حققنا هدفاً من الأهداف المرجوة من الكتاب، والهدف الثانى الذى سعينا إليه هو تدريب القارئ، طالباً كان أم رجل منشأة، على استخدام تقنيات التنبؤ الكمية على المدى القصير.





---

## المراجع

- ABRAHAM M.M., LODISH L.M., "PROMOTER: An automated promotion evaluation system", *Marketing Science*, 9(2), 1987, p.101-123.
- ARMSTRONG J.S., " Research on forecasting: A quarter-century review", *Interfaces*, vol. 16, n 3, 1986, p. 89-103.
- ASSMUS G., FARLEY J.U., LEHMANN D.R., "How advertising affect sales: Meta-analysis of econometric results", *Journal of Marketing Research*, 21, February 1984, p.65-74.
- BECHU T., BERTRAND E., *L'analyse technique – Pratique et méthodes*, 4<sup>e</sup> éd. ; Economica ; 1999.
- BOURBONNAIS R., *Econométrie: cours et exercices corrigés*, 3<sup>e</sup> éd. ; Dunod ; 2000.
- BOURBONNAIS R., TERRAZA M., *Analyse des séries temporelles en économie*, PUF, 1998.
- BOX G.E.P. JENKINS G.M., *Times series analysis forecasting and control*, San Francisco, Holden-Day, 1976.
- BROWN R.G., *Smoothing, forecasting and prediction of discrete time series*, Englewood Cliffs, Prentice-Hall, 1963.
- BROWN R.G., *Statistical forecasting for inventory control*, New York, McGraw-Hill, 1959.
- CARBONE R., GORR W.L., " Accufacy of judgmental forecasting of time series" , *Decision Sciences*, vol. 16, n 2, 1985, p. 153-160.
- CHAMBERS V.A. et al., " Choisissez votre technique de prévision", *Harvard-L'Expansion*, n 4, 1977.
- CHATFIELD C., *The Analysis of time series: theory and practice*, 4<sup>e</sup> ed., London, Chapman and Hall, 1985.
- CHOW G.G., " Technological change and the demand for computers", *American Economic Review*, vol. 57, 1967.
- CHRIST C.F., " A test of an Econometric Model of the United States", 1921-1974, in *Conference on Business Cycles*, New York, NBER, 1951.

- 
- 
- CLEVELAND W.S., DEVLIN S.J., " Calendar effects in monthly time series: modeling and adjustment", *Journal of the American Statistical Association*, vol. 77, 1982, p. 520-528.
- COOPER R.L., "The predictive performance of quarterly econometric models of the United States", in *Econometric Models of Cyclical Behavior*, New York, NBER, 1972.
- COUTROT B., DROESBEKE J-J., *Les méthodes de prévision*, 2<sup>e</sup> éd., Paris, Que Sais-je ? n 2157, 1990.
- DALRYMPLE, D.J., " Sales forecasting practices – results from a United States survey ", *International Journal of Forecasting*, vol. 4, n 3, 1987, p. 51-59.
- DAY G. S., " The product life cycle analysis and applications issues", *Journal of Marketing*, vol, 45, 1981, p. 60-67.
- DELURGIO S. A., BHAME C.D., *Forecasting systems for operations management*, Business One Irwin, 1991.
- DESMET P., LOBEZ F., " Modélisation du cycle de vie de produit: analyse comparative des principaux modèles », Non publié, IESEG, septembre 1983.
- DOBSON F., MULLER V., " Models of new product diffusion through advertising and word-of-mouth", *Management Science*, vol. 15, November 1978.
- DROESBEKE J-J., FICHET B., TASSI Ph., *Séries chronologiques : théorie et pratique des modèles ARIMA*, Paris, Economica, 1989.
- DUBOIS P.L., JOLIBERT A., *Le marketing, fondements et pratique*, 3 éd., Paris, Economica, 1998.
- ENDERS W., *Applied econometric time series*, J. Wiley, 1995.
- FAIVRE J.P., SCHWOERER J., « Une nouvelle approche des choix des consommateurs, le modèle Trade-Off », *Revue Française du Marketing*, n 55, mars avril 1975, p. 33-53.
- FARNOM N. R., STANTON L.W., *Quantitative forecasting methods*, PWS-Kent Publishing, 1989.
- GEURTS M. D., IBRAHIM I.B., " Comparing the Box-Jenkins approach with the exponentially smoothed forecasting model", *Journal of Marketing Research*, vol. 12, May 1975, p. 182-188.
-

- 
- 
- GRANGER C.W.J., Forecasting in business and economics, New York, Academic Press, 1980.
- GRANGER C.W.J., NEWBOLD P., Forecasting economic time series, 2<sup>e</sup> ed., New York, Academic Press, 1986.
- GROFF G.K., "Empirical comparison of models for short range forecasting", Management Science, vol. 20, September 1973.
- GROSS D., RAY J.L., "A general purpose forecasting simulator", Management Science, vol. 20, April 1965.
- GUADAGNI P.M., LITTLE J.D.C., "A logit model of brand choice calibrated on scanner data", Marketing Science, vol. 2, n 3, Summer 1983, p. 203-238.
- GUPTA S., "Impact of sales promotions on when, what, and how much to buy", Journal of Marketing Research, vol. XXV, November 1988, p. 342-355.
- GUPTA S., CHINTAGUNTA P., KAUL A., WITTINK D.R., "Do household scanner data provide representative inferences from brand choices: A comparison with store data", Journal of Marketing Research, vol. XXXIII, November 1996, p. 383-398.
- HAMILTON J.D., Time series analysis, Princeton University Press, 1994.
- HANKE J. E., PREITSCH A.G., Business forecasting, Allyn and Bacon, 1994.
- HARRELL S.G., TAYLOR E.D., "Modeling the product life cycle for consumer durables", Journal of Marketing, vol. 45, Fall 1981, p. 68-75.
- HOCH S.J., KIM B.D., MONTGOMERY A.L., ROSSI P.E., "Determinants of store-level price elasticity", Journal of Marketing Research, vol. XXXII, February 1995, p. 17-29.
- JAMBU M., "Estimation et prédiction de la fidélité, de la durée de vie et de la valeur économique des clients par des techniques de datamining", Revue Française du Marketing, n 170, 1998/5, p. 67-80.
- JARRETT J., Business forecasting methods, Basil Blackwell ; 1987.
- JENKINS G.M., Practical experiences with modeling and forecasting time series, St Helier, GJP Publications, 1979.

- 
- 
- JOHNSON R. M., " Trade-off analysis of consumer values", Journal of Marketing Research, vol, XI, May 1974, p. 121-127.
- JORGENSEN D. W., " The predictive performance of econometric models of quarterly investment behavior", Econometrica, March 1970.
- KARANDE K.W., KUMAR V., "The effects of brand characteristics and retailer policies on response to retail price promotions", Journal of retailing, vol. 71, n 3, 1995, p.249-295.
- KIRPY R.M., " A comparison of short and medium range statistical forecasting methods", Management Science, vol. 4, 1966.
- KRAMPF R.F., " The turning point problem in smoothing models", These de Doctorat, non publié, University de Cincinnati, 1972.
- LACKMAN C.L., " Gompertz curve forecasting: a new product application", Journal of the market research society, January 1978.
- LAMBIN J.J., Le marketing stratégique, Paris, McGraw-Hill, 1986.
- LEE T.S., COOPER F.W., ADAM E.E., "The effects of forecasting errors on the total costs of operations", Omega International Journal of Management Science, vol. 21, n 5, p. 541-550.
- LEVINE A.H., " Forecasting techniques", Management Accounting, January 1967.
- LITTLE J.D.C., " Cover story: An expert system to find the news in scanner data", expose au centre HEC-ISA dans le cadre de l' Association Française du Marketing, 21 octobre 1988.
- MABERT V.A., " Statistical versus sales force", Working paper, Kronnert graduate School, Purdue University, 1975.
- MAHAJAN V., MUELLER C.W., " Innovation diffusion and new product growth models in marketing", Journal of Marketing, vol, 43, 1979.
- MAHAJAN V., PETERSON R.A., "Innovation diffusion in a dynamic potential adopter population", Management Science, November 1978.
- MAKRIDAKIS S., et al., "The accuracy of extrapolation (time series) methods: results of a forecasting competition", Journal of forecasting, April – June 1982.
-

- 
- 
- MAKRIDAKIS S., WHEELWRIGHT S.S., MCGEE V.E., *Forecasting: methods and applications*, 2<sup>e</sup> ed., New York, Wiley, 1983.
- MARICOURT R. de, "Prévision des ventes: Il faut faire confiance a vos vendeurs", *Revue Française de Gestion*, novembre décembre 1982.
- MARICOURT R. de ; *La prévision des ventes* ; Paris ; PUF ; 1985.
- MCLAUGHLIN R.L., "The real record of the econometric forecasting", *Business Economics*, vol. 10, n 3, 1975.
- MELARD G., *Méthodes de prevision a court terme*, Bruxelles, Ellipses, 1990.
- MENTZER J., COX J., "Familiarity, application and performance of sales forecasting techniques", *Journal of Forecasting*, vol. 3, n 1, 1984, p. 27-36.
- MERUNKA D., *Decisions Marketing*, Paris, Dalloz, 1992.
- MIDGLEY D.F., "Toward a theory of the product life cycle: explaining diversity", *Journal of Marketing*, vol. 45, Fall 1981, p. 109-115.
- NAYLOR T. H., et al., « An alternative to econometric forecasting", *International Statistical Review*, vol. 62, November et December 1972.
- NELSON C., "The prediction performance of the FRB-HII-PENN model of the US economy", *American Economic Review*, vol. 62, December 1972.
- NESLIN S.A., "A market response model for coupon promotion", *Marketing Science*, 9(2), 1990, p. 125-145.
- NEWBOLD P., GRANGER C.W.J., " Experience with forecasting univariate time series and the combination of forecasts", *Journal of the Royal Statistical Society, series A*, vol. 137, 1974.
- PARFITT J.H., COLLINS B.J.K., "Use of consumer panels for brand share prediction", *Journal of Marketing Research*, 5(2), May 1968, p. 131-146.
- PHILPS L. et al., *Analyse chronologique*, 3<sup>e</sup> ed., Edition universitaire, DeBoeck Université, 1990.
- PINDYCK R.S., RUBINFELD D.L., *Econometric models and economic forecasts*, New York, McGraw-Hill, 1986.
-

- 
- 
- QUALLS W., OLSHAVSY R.W., MICHAELS R.E., "Shortening of the PLC – An empirical test", *Journal of Marketing*, vol. 45, Fall 1981, p. 76-80.
- RAINE J.E., "Self adaptative forecasting considered", *Decision Sciences*, April 1971.
- REIBSTEIN D.J., TRAVER P.A., "Factors influencing coupon redemption rate", *Journal of Marketing*, 46, Autumn 1982, p. 102-113.
- REID D.J., "Forecasting in action: a comparison of forecasting techniques", conference of Operation Research Society Group on long range planning and forecasting, 1971.
- ROBERTS S.A., "A general class of Holt – Winters type forecasting models", *Management Science*, vol. 28, 1982, p. 808-820.
- SANDERS N.R., MANRODT K.B., "Forecasting Practices in US corporations: Survey results", *Interfaces*, vol. 24, n 2, 1994, p. 92-100.
- SHANKAR V., KRISHNAMURTHI L., "Relating price sensitivity to retailer promotional variables and pricing policy: An empirical analysis", *Journal of Retailing*, 72(3), 1996, p. 249-272.
- SHISKIN J., *Les signaux avertisseurs des récessions et des reprises*, Paris, Gauthier – Villars, 1964.
- SLUTZKY E., "The summation of random causes as the source of cyclic processes", *Econometrica*, vol. 5, 1937.
- SPROLES G.B., "Analyzing fashion life cycles – principles and perspectives", *Journal of Marketing*, vol. 45, Fall 1981, p. 116-124.
- TELLIS G.J., "Advertising exposure, loyalty, and brand purchase: A two – stage model of choice", *Journal of Marketing Research*, vol. XXV, May 1988a, p. 134-144.
- TELLIS G.J., "The price elasticity of selective demand: A meta – analysis of econometric models of sales", *Journal of Marketing Research*, vol. XXV, November 1988b, p. 331-341.
- TELLIS G.J., CRAWFORD C.M., "An evolutionary approach to product growth theory", *Journal of Marketing*, vol. 45, Fall 1981, p. 125-132.
- TENENHAUS M., *Méthode statistique en gestion*, Dunod, 1994.

- 
- TERSINE R.J., Principles of inventory and materials management, Prentice Hall, 1994.
- THEIL H., « A multinomial extension of the linear logit model », International Economic Review, 10, October 1969, p. 251-259.
- THOMAS A., Économétrie des variables qualitatives, Paris, Dunod, 2000.
- THORELLI H.B., BURNETT S.C., « The nature of product life cycle for industrial goods businesses », Journal of Marketing, vol. 45, Fall 1981, p. 97-108.
- TIAO G.C., BOX G.E.P., « Modeling multiple time series with applications », Journal of the American Statistical Association, vol. 76, 1981, p. 802-816.
- TIGERT D., FARIVAR B., « The Bass new product growth model: A sensitivity analysis for a high technology product », Journal of Marketing, vol. 45, Fall 1981, p. 81-90.
- VALLIN Ph., La logistique: modèles et méthodes du pilotage des flux, Economica, 1999.
- VATE M., Statistique chronologique et prévision, Economica, 1993.
- VOLLE P., « Mesurer l'efficacité des promotions: modèles, données, méthodologies », Document du 6<sup>e</sup> Challenge de la Promotion des ventes, avril 1994.
- WHEELWRIGHT S.C., MAKRIDAKIS S., Forecasting methods for management, 3<sup>e</sup> ed., New York, Wiley, 1985.
- WINTERS P.R., « Forecasting sales by exponentially weighted moving averages », Management Science, vol. 6, 1960, p. 324-342.
- WONNACOTT R.J., WONNACOTT T.H., Statistique, Economica, 1991.





## الجدول الإحصائية

- ١- جدول التوزيع الطبيعي Laplace Gauss
- ٢- جدول توزيع ستيودنت Student
- ٣- جدول توزيع كاي مربع Chi-2
- ٤- جدول توزيع فيشر Fisher-Snedecor
- ٥- جدول توزيع فيشر Fisher-Snedecor (تتمة)
- ٦- جدول توزيع داربين واتسون Durbin-Watson



# ١- جدول الدالة التكاملية لقانون التوزيع الطبيعي:

(احتمال الحصول على قيمة أقل من  $x$ ).



$$F(x) = \int_{-\infty}^x \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-u^2/2} du$$

$x$	0,00	0,01	0,02	0,03	0,04	0,05	0,06	0,07	0,08	0,09
0,0	0,500 00	0,503 99	0,507 98	0,511 97	0,515 95	0,519 94	0,523 92	0,527 90	0,531 88	0,535 86
0,1	0,539 83	0,543 80	0,547 76	0,551 72	0,555 67	0,559 62	0,563 56	0,567 50	0,571 42	0,575 35
0,2	0,579 26	0,583 17	0,587 06	0,590 95	0,594 84	0,598 71	0,602 57	0,606 42	0,610 26	0,614 09
0,3	0,617 91	0,621 72	0,625 52	0,629 30	0,633 07	0,636 83	0,640 58	0,644 31	0,648 03	0,651 73
0,4	0,655 42	0,659 10	0,662 76	0,666 40	0,670 03	0,763 65	0,677 24	0,680 82	0,684 39	0,687 93
0,5	0,691 46	0,694 97	0,698 47	0,701 94	0,705 40	0,708 84	0,712 26	0,715 66	0,719 04	0,722 40
0,6	0,725 75	0,729 07	0,732 37	0,735 65	0,738 91	0,742 15	0,745 37	0,748 57	0,751 75	0,754 90
0,7	0,758 04	0,761 15	0,764 24	0,767 31	0,770 35	0,773 37	0,776 37	0,779 35	0,782 30	0,785 24
0,8	0,788 14	0,791 03	0,793 89	0,796 73	0,799 55	0,802 34	0,805 11	0,807 85	0,810 57	0,813 27
0,9	0,815 94	0,818 59	0,821 21	0,823 81	0,826 39	0,828 94	0,831 47	0,833 98	0,836 46	0,838 91
1,0	0,841 34	0,843 75	0,846 14	0,848 50	0,850 83	0,853 14	0,855 43	0,857 69	0,859 93	0,862 14
1,1	0,864 33	0,866 50	0,868 64	0,870 76	0,872 86	0,874 93	0,876 98	0,879 00	0,881 00	0,882 98
1,2	0,884 93	0,886 86	0,888 77	0,890 65	0,892 51	0,894 35	0,896 17	0,897 96	0,899 73	0,901 47
1,3	0,903 20	0,904 90	0,906 58	0,908 24	0,909 88	0,911 49	0,913 09	0,914 66	0,916 21	0,917 74
1,4	0,919 24	0,920 73	0,922 20	0,923 64	0,925 07	0,926 47	0,927 86	0,929 22	0,930 56	0,931 89
1,5	0,933 19	0,934 48	0,935 74	0,936 99	0,938 22	0,939 43	0,940 62	0,941 79	0,942 95	0,944 08
1,6	0,945 20	0,946 30	0,947 38	0,948 45	0,949 50	0,950 53	0,951 54	0,952 54	0,953 52	0,954 49
1,7	0,955 43	0,956 37	0,957 28	0,958 18	0,959 07	0,959 94	0,960 80	0,961 64	0,962 46	0,963 27
1,8	0,964 07	0,964 85	0,965 62	0,966 38	0,967 12	0,967 84	0,968 56	0,969 26	0,969 95	0,970 62
1,9	0,971 28	0,971 93	0,972 57	0,973 20	0,973 81	0,974 41	0,975 00	0,975 58	0,976 15	0,976 70
2,0	0,977 25	0,977 78	0,978 31	0,978 82	0,979 32	0,979 82	0,980 30	0,980 77	0,981 24	0,981 69
2,1	0,982 14	0,982 57	0,983 00	0,983 41	0,983 82	0,984 22	0,984 61	0,985 00	0,985 37	0,985 74
2,2	0,986 10	0,986 45	0,986 79	0,987 13	0,987 45	0,987 78	0,988 09	0,988 40	0,988 70	0,988 99
2,3	0,989 28	0,989 56	0,989 83	0,990 10	0,990 36	0,990 61	0,990 86	0,991 11	0,991 34	0,991 58
2,4	0,991 80	0,992 02	0,992 24	0,992 45	0,992 66	0,992 86	0,993 05	0,993 24	0,993 43	0,993 61
2,5	0,993 79	0,993 96	0,994 13	0,994 30	0,994 46	0,994 61	0,994 77	0,994 92	0,995 06	0,995 20
2,6	0,995 34	0,995 47	0,995 60	0,995 73	0,995 85	0,995 98	0,996 09	0,996 21	0,996 32	0,996 43
2,7	0,996 53	0,996 64	0,996 74	0,996 83	0,996 93	0,997 02	0,997 11	0,997 20	0,997 28	0,997 36
2,8	0,997 44	0,997 52	0,997 60	0,997 67	0,997 74	0,997 81	0,997 88	0,997 95	0,998 01	0,998 07
2,9	0,998 13	0,998 19	0,998 25	0,998 31	0,998 36	0,998 41	0,998 46	0,998 51	0,998 56	0,998 61

Table pour les grandes valeurs de  $x$

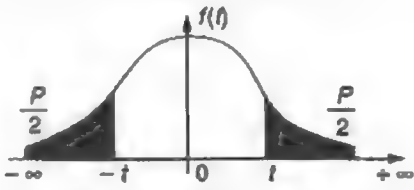
$x$	3,0	3,1	3,2	3,3	3,4	3,5	3,6	3,8	4,0	4,5
$F(x)$	0,998 65	0,999 04	0,999 31	0,999 52	0,999 66	0,999 76	0,999 841	0,999 928	0,999 968	0,999 997

ملاحظة: يعطى الجدول قيم  $F(x)$  من أجل  $x$  الموجبة. وعندما تكون سالبة، يجب حساب المتمم إلى الواحد للقيمة المقروءة فى الجدول.

مثال: من أجل  $x = 1.37$   $F(x) = 0.9147$  ومن أجل  $x = 1.37$   $F(x) = 0.08537$ .

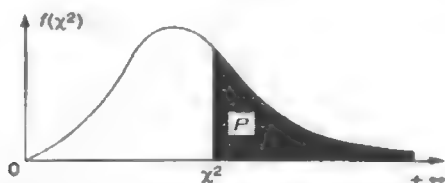
## ٢- جدول توزيع ستودنت t:

(القيم لـ t ذات الاحتمال P أن تكون متجاوزة بالقيمة المطلقة للقيمة المحسوبة عند ١ درجة حرية).

													
v \ P	0,90	0,80	0,70	0,60	0,50	0,40	0,30	0,20	0,10	0,05	0,02	0,01	0,001
1	0,158	0,325	0,510	0,727	1,000	1,376	1,963	3,078	6,314	12,706	31,821	63,657	636,619
2	0,142	0,289	0,445	0,617	0,816	1,061	1,386	1,886	2,920	4,303	6,965	9,925	31,598
3	0,137	0,277	0,424	0,584	0,765	0,978	1,250	1,638	2,353	3,182	4,541	5,841	12,929
4	0,134	0,271	0,414	0,569	0,741	0,941	1,190	1,533	2,132	2,776	3,747	4,604	8,610
5	0,132	0,267	0,408	0,559	0,727	0,920	1,156	1,476	2,015	2,571	3,365	4,032	6,869
6	0,131	0,265	0,404	0,553	0,718	0,906	1,134	1,440	1,943	2,447	3,143	3,707	5,959
7	0,130	0,263	0,402	0,549	0,711	0,896	1,119	1,415	1,895	2,365	2,998	3,499	5,408
8	0,130	0,262	0,399	0,546	0,706	0,889	1,108	1,397	1,860	2,306	2,896	3,355	5,041
9	0,129	0,261	0,398	0,543	0,703	0,883	1,100	1,383	1,833	2,262	2,821	3,250	4,781
10	0,129	0,260	0,397	0,540	0,700	0,879	1,093	1,372	1,812	2,228	2,764	3,169	4,587
11	0,129	0,260	0,396	0,539	0,697	0,876	1,088	1,363	1,796	2,201	2,718	3,106	4,437
12	0,128	0,259	0,395	0,538	0,695	0,873	1,083	1,356	1,782	2,179	2,681	3,055	4,318
13	0,128	0,259	0,394	0,537	0,694	0,870	1,079	1,350	1,771	2,160	2,650	3,012	4,221
14	0,128	0,258	0,393	0,536	0,692	0,866	1,076	1,345	1,761	2,145	2,624	2,977	4,140
15	0,128	0,258	0,393	0,535	0,691	0,866	1,074	1,341	1,753	2,131	2,602	2,947	4,073
16	0,128	0,258	0,392	0,534	0,690	0,865	1,071	1,337	1,746	2,120	2,583	2,921	4,015
17	0,128	0,257	0,392	0,534	0,689	0,863	1,069	1,333	1,740	2,110	2,567	2,898	3,965
18	0,127	0,257	0,392	0,533	0,688	0,862	1,067	1,330	1,734	2,101	2,552	2,878	3,922
19	0,127	0,257	0,391	0,533	0,688	0,861	1,066	1,328	1,729	2,093	2,539	2,861	3,883
20	0,127	0,257	0,391	0,532	0,687	0,860	1,064	1,325	1,725	2,086	2,528	2,845	3,850
21	0,127	0,257	0,391	0,532	0,686	0,859	1,063	1,323	1,721	2,080	2,518	2,831	3,819
22	0,127	0,256	0,390	0,532	0,686	0,858	1,061	1,321	1,717	2,074	2,508	2,819	3,792
23	0,127	0,256	0,390	0,531	0,685	0,858	1,060	1,319	1,714	2,069	2,500	2,807	3,767
24	0,127	0,256	0,390	0,531	0,685	0,857	1,059	1,318	1,711	2,064	2,492	2,797	3,745
25	0,127	0,256	0,390	0,531	0,684	0,856	1,058	1,316	1,708	2,060	2,485	2,787	3,725
26	0,127	0,256	0,390	0,531	0,684	0,856	1,058	1,315	1,706	2,056	2,479	2,779	3,707
27	0,137	0,256	0,389	0,530	0,684	0,855	1,057	1,314	1,703	2,052	2,473	2,771	3,690
28	0,127	0,256	0,389	0,530	0,683	0,855	1,056	1,313	1,701	2,048	2,467	2,763	3,674
29	0,127	0,256	0,389	0,530	0,683	0,854	1,055	1,311	1,699	2,045	2,462	2,756	3,649
30	0,127	0,256	0,389	0,530	0,683	0,854	1,055	1,310	1,697	2,042	2,457	2,750	3,656
40	0,126	0,255	0,388	0,529	0,681	0,851	1,050	1,303	1,684	2,021	2,423	2,704	3,551
80	0,126	0,254	0,387	0,527	0,679	0,848	1,046	1,296	1,671	2,000	2,390	2,660	3,460
120	0,126	0,254	0,386	0,526	0,677	0,845	1,041	1,289	1,658	1,980	2,358	2,617	3,373
∞	0,126	0,253	0,385	0,524	0,674	0,842	1,036	1,282	1,645	1,960	2,326	2,576	3,291

### ٣- جدول توزيع كاي مربع (قانون توزيع بيرسون):

(القيم لـ  $\chi^2$  ذات الاحتمال P أن تكون متجاوزة للقيمة المحسوبة).



$\nu$	P	0,990	0,975	0,950	0,900	0,100	0,050	0,025	0,010	0,001
1	0,000 2	0,001 0	0,003 9	0,015 8	2,71	3,84	5,02	6,63	10,83	
2	0,02	0,05	0,10	0,21	4,61	5,99	7,38	9,21	13,82	
3	0,12	0,22	0,35	0,58	6,25	7,81	9,35	11,34	16,27	
4	0,30	0,48	0,71	1,06	7,78	9,49	11,14	13,28	18,47	
5	0,55	0,83	1,15	1,61	9,24	11,07	12,83	15,09	20,52	
6	0,87	1,24	1,64	2,20	10,64	12,59	14,45	16,81	22,46	
7	1,24	1,69	2,17	2,83	12,02	14,07	16,01	18,47	24,32	
8	1,65	2,18	2,73	3,49	13,36	15,51	17,53	20,09	26,13	
9	2,09	2,70	3,33	4,17	14,68	16,92	19,02	21,67	27,88	
10	2,56	3,25	3,94	4,87	15,99	18,31	20,48	23,21	29,59	
11	3,05	3,82	4,57	5,58	17,27	19,67	21,92	24,72	31,26	
12	3,57	4,40	5,23	6,30	18,55	21,03	23,34	26,22	32,91	
13	4,11	5,01	5,89	7,04	19,81	22,36	24,74	27,69	34,53	
14	4,66	5,63	6,57	7,79	21,06	23,68	26,12	29,14	36,12	
15	5,23	6,26	7,26	8,55	22,31	25,00	27,49	30,58	37,70	
16	5,81	6,91	7,96	9,31	23,54	26,30	28,84	32,00	39,25	
17	6,41	7,56	8,67	10,08	24,77	27,59	30,19	33,41	40,79	
18	7,01	8,23	9,39	10,86	25,99	28,87	31,53	34,80	42,31	
19	7,63	8,91	10,12	11,65	27,20	30,14	32,85	36,19	43,82	
20	8,26	9,59	10,85	12,44	28,41	31,41	34,17	37,57	45,32	
21	8,90	10,28	11,59	13,24	29,61	32,67	35,48	38,93	46,80	
22	9,54	10,98	12,34	14,04	30,81	33,92	36,78	40,29	48,27	
23	10,20	11,69	13,09	14,85	32,01	35,17	38,08	41,64	49,73	
24	10,86	12,40	13,85	15,66	33,20	36,41	39,37	42,98	51,18	
25	11,52	13,12	14,61	16,47	34,38	37,65	40,65	44,31	52,62	
26	12,20	13,84	15,38	17,29	35,56	38,88	41,92	45,64	54,05	
27	12,88	14,54	16,15	18,11	36,74	40,11	43,19	46,96	55,48	
28	13,57	15,31	16,93	18,94	37,92	41,34	44,46	48,28	56,89	
29	14,26	16,05	17,71	19,77	39,09	42,56	45,72	49,59	58,30	
30	14,95	16,79	18,49	20,60	40,26	43,77	46,98	50,89	59,70	

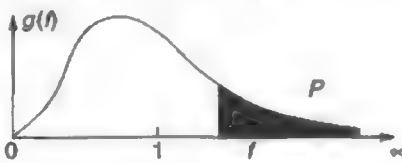
عندما يكون  $\nu > 30$  يمكننا قبول أن المقدار  $\sqrt{2\nu^2} - \sqrt{2\nu - 1}$  يتبع توزيعاً طبيعياً مركزياً.

مثال: حساب القيمة  $\chi^2$  الموافقة لاحتمال  $p = 0.10$  عندما يكون  $\nu = 41$ . من خلال الجدول (١) نحسب  $x$  من أجل  $p = 0.10$  فنجدها  $x = 1.2816$ . ومن ثم:

$$\chi^2 = \frac{[x + \sqrt{2\nu - 1}]^2}{2} = \frac{1}{2} [1.2816 + \sqrt{82} - 1]^2 = 52.85$$

#### ٤- جدول توزيع فيشر $F$ :

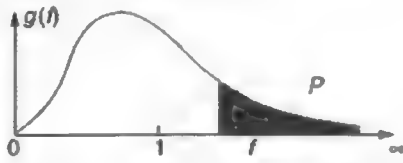
(القيم ل  $F$  ذات الاحتمال  $P$  أن تكون متجاوزة للقيمة المحسوبة  $(F = S_1^2/S_2^2)$ ).

										
$v_2$	$v_1 = 1$		$v_1 = 2$		$v_1 = 3$		$v_1 = 4$		$v_1 = 5$	
	$P = 0,05$	$P = 0,01$	$P = 0,05$	$P = 0,01$	$P = 0,05$	$P = 0,01$	$P = 0,05$	$P = 0,01$	$P = 0,05$	$P = 0,01$
1	161,40	4 052,00	199,50	4 999,00	215,70	5 403,00	224,60	5 625,00	230,20	5 764,00
2	18,51	98,49	19,00	99,00	19,16	99,17	19,25	99,25	19,30	99,30
3	10,13	34,12	9,55	30,81	9,28	29,46	9,12	28,71	9,01	28,24
4	7,71	21,20	6,94	18,00	6,59	16,09	6,39	15,98	6,26	15,52
5	6,61	16,26	5,79	13,27	5,41	12,06	5,19	11,39	5,05	10,97
6	5,99	13,74	5,14	10,91	4,76	9,78	4,53	9,15	4,39	8,75
7	5,59	12,25	4,74	9,55	4,35	8,45	4,12	7,85	3,97	7,45
8	5,32	11,26	4,46	8,65	4,07	7,59	3,84	7,01	3,69	6,63
9	5,12	10,56	4,26	8,02	3,86	6,99	3,63	6,42	3,48	6,06
10	4,96	10,04	4,10	7,56	3,71	6,55	3,48	5,99	3,33	5,64
11	4,84	9,65	3,98	7,20	3,59	6,22	3,36	5,67	3,20	5,32
12	4,75	9,33	3,88	6,93	3,49	5,95	3,26	5,41	3,11	5,06
13	4,67	9,07	3,80	6,70	3,41	5,74	3,18	5,20	3,02	4,86
14	4,60	8,86	3,74	6,51	3,34	5,56	3,11	5,03	2,96	4,69
15	4,54	8,68	3,68	6,36	3,29	5,42	3,06	4,89	2,90	4,56
16	4,49	8,53	3,63	6,23	3,24	5,29	3,01	4,77	2,85	4,44
17	4,45	8,40	3,59	6,11	3,20	5,18	2,96	4,67	2,81	4,34
18	4,41	8,28	3,55	6,01	3,16	5,09	2,93	4,58	2,77	4,25
19	4,38	8,18	3,52	5,93	3,13	5,01	2,90	4,50	2,74	4,17
20	4,35	8,10	3,49	5,85	3,10	4,94	2,87	4,43	2,71	4,10
21	4,32	8,02	3,47	5,78	3,07	4,87	2,84	4,37	2,68	4,04
22	4,30	7,94	3,44	5,72	3,05	4,82	2,82	4,31	2,66	3,99
23	4,28	7,88	3,42	5,66	3,03	4,76	2,80	4,26	2,64	3,94
24	4,26	7,82	3,40	5,61	3,01	4,72	2,78	4,22	2,62	3,90
25	4,24	7,77	3,38	5,57	2,99	4,68	2,76	4,18	2,60	3,86
26	4,22	7,72	3,37	5,53	2,98	4,64	2,74	4,14	2,59	3,82
27	4,21	7,68	3,35	5,49	2,96	4,60	2,73	4,11	2,57	3,78
28	4,20	7,64	3,34	5,45	2,95	4,57	2,71	4,07	2,56	3,75
29	4,18	7,60	3,33	5,42	2,93	4,54	2,70	4,04	2,54	3,73
30	4,17	7,56	3,32	5,39	2,92	4,51	2,69	4,02	2,53	3,70
40	4,08	7,31	3,23	5,18	2,84	4,31	2,61	3,83	2,45	3,51
80	4,00	7,08	3,15	4,98	2,76	4,13	2,52	3,65	2,37	3,34
120	3,92	6,85	3,07	4,79	2,68	3,95	2,45	3,48	2,29	3,17
∞	3,84	6,64	2,99	4,60	2,60	3,78	2,37	3,32	2,21	3,02

تمثل  $S_1^2$  التباين الأكبر من التباينين المقدرين وباعتبار  $v_1$  درجة حرية.

## ٥- جدول توزيع فيشر $F$ (تتمة الجدول السابق):

(القيم لـ  $F$  ذات الاحتمال  $P$  أن تكون متجاوزة للقيمة المحسوبة  $(F = S_1^2/S_2^2)$ ).

										
$\nu_2$	$\nu_1 = 6$		$\nu_1 = 8$		$\nu_1 = 12$		$\nu_1 = 24$		$\nu_1 = \infty$	
	$P = 0.05$	$P = 0.01$	$P = 0.05$	$P = 0.01$	$P = 0.05$	$P = 0.01$	$P = 0.05$	$P = 0.01$	$P = 0.05$	$P = 0.01$
1	234,40	5 859,00	238,90	5 981,00	243,90	6 106,00	249,00	6 234,00	254,30	6,366
2	19,33	99,33	19,37	99,36	19,41	99,42	19,45	99,46	19,50	99,50
3	8,94	27,91	8,84	27,49	8,74	27,05	8,64	26,60	8,53	26,12
4	6,16	15,21	6,04	14,80	5,91	14,37	5,77	13,93	5,63	13,46
5	4,95	10,67	4,82	10,27	4,68	9,89	4,53	9,47	4,36	9,02
6	4,28	8,47	4,15	8,10	4,00	7,72	3,84	7,31	3,67	6,88
7	3,87	7,19	3,73	6,84	3,57	6,47	3,41	6,07	3,23	5,65
8	3,58	6,37	3,44	6,03	3,28	5,67	3,12	5,28	2,93	4,86
9	3,37	5,80	3,23	5,47	3,07	5,11	2,90	4,73	2,71	4,31
10	3,22	5,39	3,07	5,06	2,91	4,71	2,74	4,33	2,54	3,91
11	3,09	5,07	2,95	4,74	2,79	4,40	2,61	4,02	2,40	3,60
12	3,00	4,82	2,85	4,50	2,69	4,16	2,50	3,78	2,30	3,36
13	2,92	4,62	2,77	4,30	2,60	3,96	2,42	3,59	2,21	3,16
14	2,85	4,46	2,70	4,14	2,53	3,80	2,35	3,43	2,13	3,00
15	2,79	4,32	2,64	4,00	2,48	3,67	2,29	3,29	2,07	2,87
16	2,74	4,20	2,59	3,89	2,42	3,55	2,24	3,18	2,01	2,75
17	2,70	4,10	2,55	3,79	2,38	3,45	2,19	3,08	1,96	2,65
18	2,66	4,01	2,51	3,71	2,34	3,37	2,15	3,00	1,92	2,57
19	2,63	3,94	2,48	3,63	2,31	3,30	2,11	2,92	1,88	2,49
20	2,60	3,87	2,45	3,56	2,28	3,23	2,08	2,86	1,84	2,42
21	2,57	3,81	2,42	3,51	2,25	3,17	2,05	2,80	1,81	2,36
22	2,55	3,76	2,40	3,45	2,23	3,12	2,03	2,75	1,78	2,31
23	2,53	3,71	2,38	3,41	2,20	3,07	2,00	2,70	1,76	2,26
24	2,51	3,67	2,36	3,36	2,18	3,03	1,98	2,66	1,73	2,21
25	2,49	3,63	2,34	3,32	2,16	2,99	1,96	2,62	1,71	2,17
26	2,47	3,59	2,32	3,29	2,15	2,96	1,95	2,58	1,69	2,13
27	2,46	3,56	2,30	3,26	2,13	2,93	1,93	2,55	1,67	2,10
28	2,44	3,53	2,29	3,23	2,12	2,90	1,91	2,52	1,65	2,06
29	2,43	3,50	2,28	3,20	2,10	2,87	1,90	2,49	1,64	2,03
30	2,42	3,47	2,27	3,17	2,09	2,84	1,89	2,47	1,62	2,01
40	2,34	3,29	2,18	2,99	2,00	2,66	1,79	2,29	1,51	1,80
80	2,25	3,12	2,10	2,82	1,92	2,50	1,70	2,12	1,39	1,60
120	2,17	2,96	2,01	2,66	1,83	2,34	1,61	1,95	1,25	1,38
$\infty$	2,09	2,80	1,94	2,51	1,75	2,18	1,52	1,79	1,00	1,00

تمثل  $S_1^2$  التباين الأكبر من التباينين المقدرين وباعتبار  $\nu_1$  درجة حرية.



٦- جدول توزيع دارين واتسون ( $a = 5\%$ )  $DW$ :

n	k = 1		k = 2		k = 3		k = 4		k = 5	
	$d_1$	$d_2$	$d_1$	$d_2$	$d_1$	$d_2$	$d_1$	$d_2$	$d_1$	$d_2$
15	1,08	1,36	0,95	1,54	0,82	1,75	0,69	1,97	0,56	2,21
16	1,10	1,37	0,98	1,54	0,86	1,73	0,74	1,93	0,62	2,15
17	1,13	1,38	1,02	1,54	0,90	1,71	0,78	1,90	0,67	2,10
18	1,16	1,39	1,05	1,53	0,93	1,69	0,82	1,87	0,71	2,06
19	1,18	1,40	1,08	1,53	0,97	1,68	0,86	1,85	0,75	2,02
20	1,20	1,41	1,10	1,54	1,00	1,68	0,90	1,83	0,79	1,99
21	1,22	1,42	1,13	1,54	1,03	1,67	0,93	1,81	0,83	1,96
22	1,24	1,43	1,15	1,54	1,05	1,66	0,96	1,80	0,86	1,94
23	1,26	1,44	1,17	1,54	1,08	1,66	0,99	1,79	0,90	1,92
24	1,27	1,45	1,19	1,55	1,10	1,66	1,01	1,78	0,93	1,90
25	1,29	1,45	1,21	1,55	1,12	1,66	1,04	1,77	0,95	1,89
26	1,30	1,46	1,22	1,55	1,14	1,65	1,06	1,76	0,98	1,88
27	1,32	1,47	1,24	1,56	1,16	1,65	1,08	1,76	1,01	1,86
28	1,33	1,48	1,26	1,56	1,18	1,65	1,10	1,75	1,03	1,85
29	1,34	1,48	1,27	1,56	1,20	1,65	1,12	1,74	1,05	1,84
30	1,35	1,49	1,28	1,57	1,21	1,65	1,14	1,74	1,07	1,83
31	1,36	1,50	1,30	1,57	1,23	1,65	1,16	1,74	1,09	1,83
32	1,37	1,50	1,31	1,57	1,24	1,65	1,18	1,73	1,11	1,82
33	1,38	1,51	1,32	1,58	1,26	1,65	1,19	1,73	1,13	1,81
34	1,39	1,51	1,33	1,58	1,27	1,65	1,21	1,73	1,15	1,81
35	1,40	1,52	1,34	1,58	1,28	1,65	1,22	1,73	1,16	1,80
36	1,41	1,52	1,35	1,59	1,29	1,65	1,24	1,73	1,18	1,80
37	1,42	1,53	1,36	1,59	1,31	1,66	1,25	1,72	1,19	1,80
38	1,43	1,54	1,37	1,59	1,32	1,66	1,26	1,72	1,21	1,79
39	1,43	1,54	1,38	1,60	1,33	1,66	1,27	1,72	1,22	1,79
40	1,44	1,54	1,39	1,60	1,34	1,66	1,29	1,72	1,23	1,79
45	1,48	1,57	1,43	1,62	1,38	1,67	1,34	1,72	1,29	1,78
50	1,50	1,59	1,46	1,63	1,42	1,67	1,38	1,72	1,34	1,77
55	1,53	1,60	1,49	1,64	1,45	1,68	1,41	1,72	1,38	1,77
60	1,55	1,62	1,51	1,65	1,48	1,69	1,44	1,73	1,41	1,77
65	1,57	1,63	1,54	1,66	1,50	1,70	1,47	1,73	1,44	1,77
70	1,58	1,64	1,55	1,67	1,52	1,70	1,49	1,74	1,46	1,77
75	1,60	1,65	1,57	1,68	1,54	1,71	1,51	1,74	1,49	1,77
80	1,61	1,66	1,59	1,69	1,56	1,72	1,53	1,74	1,51	1,77
85	1,62	1,67	1,60	1,70	1,57	1,72	1,55	1,75	1,52	1,77
90	1,63	1,68	1,61	1,70	1,59	1,73	1,57	1,75	1,54	1,78
95	1,64	1,69	1,62	1,71	1,60	1,73	1,58	1,75	1,56	1,78
100	1,65	1,69	1,63	1,72	1,61	1,74	1,59	1,76	1,57	1,78

تمثل  $k$  عدد المتغيرات الخارجية (بما فيها الحد الثابت) و  $T$  حجم العينة.

## ترجمة المصطلحات

### ١- (فرنسي - إنجليزي - عربي):

هذه الترجمة لأهم المفردات المستخدمة في مجال التنبؤ بالمبيعات و هي مرتبة حسب التسلسل الأبجدي باللغة الفرنسية وتشمل المقابل لها باللغة الإنجليزية<sup>(١)</sup> وباللغة العربية.

عربي	إنجليزي	فرنسي
توفيق المنحنى	Fit, fitting	Ajustement
عشوائى	Random	Aléatoire (terme)
ضجة بيضاء	White noise	Bruit blanc
دورة حياة المنتج	Product life cycle	Cycle de vie du produit
تأخيرات زمنية	Time lags	Décalages temporels
درجات الحرية	Degrees of freedom	Degrés de liberté
نزع المركبة الفصلية	Deseasonalization	Désaisonnalisation
بيانات	Data	Données
انحراف معيارى	Standard deviation	Ecart-type
عينة	Sample	Echantillon
تصفية	Filtering	Filtrage
مؤشرات تقديمية	Leading indicators	Indicateurs en avance
مؤشرات تأخيرية	Lagging indicators	Indicateurs retardes
صقل	Smoothing	Lissage
متوسط حسابى	Mean	Moyenne
متوسط متحرك	Moving Average	Moyenne mobile
تنبؤ	Forecast (to forecast)	Prévision (prévoir)
سياق عشوائى	Random walk	Processus aléatoire
فصلي	Seasonal	Saisonnier
سلسلة زمنية	Time series	Série chronologique
استقرارية	Stationary	Stationnaire
نزعة (مركبة اتجاه عام)	Trend	Tendance
متغير صامت	Dummy variable	Variable muette
متغيرات تفسيرية	Explanatory variable	Variables explicatives

(١) تمت الإشارة فقط إلى المصطلحات الإنجليزية التى ترجمتها قد لا تكون واضحة بشكل مباشر.

## ٢- (عربي - إنجليزي - فرنسي):

هذه الترجمة لأهم المفردات المستخدمة في مجال التنبؤ بالمبيعات وهي مرتبة حسب التسلسل الأبجدي باللغة العربية وتشمل المقابل لها باللغة الإنجليزية وباللغة الفرنسية.

عربي	إنجليزي	فرنسي
استقرارية	Stationary	Stationnaire
انحراف معياري	Standard deviation	Ecart-type
بيانات	Data	Données
تأخيرات زمنية	Time lags	Décalages temporels
تصفية	Filtering	Filtrage
تنبؤ	(Forecast (to forecast	(Prévision (prévoir
توفيق المنحنى	Fit, fitting	Ajustement
درجات الحرية	Degrees of freedom	Degrés de liberté
دورة حياة المنتج	Product life cycle	Cycle de vie du produit
سلسلة زمنية	Time series	Série chronologique
سياق عشوائي	Random walk	Processus aléatoire
صقل	Smoothing	Lissage
ضجة بيضاء	White noise	Bruit blanc
عشوائي	Random	(Aléatoire (terme
عينة	Sample	Echantillon
فصلي	Seasonal	Saisonnier
مؤشرات تأخيرية	Lagging indicators	Indicateurs retardes
مؤشرات تقديمية	Leading indicators	Indicateurs en avance
متغير صامت	Dummy variable	Variable muette
متغيرات تفسيرية	Explanatory variable	Variables explicatives
متوسط حسابي	Mean	Moyenne
متوسط متحرك	Moving Average	Moyenne mobile
نزع المركبة الفصلية	Deseasonalization	Désaisonnalisation
نزعة (مركبة اتجاه عام)	Trend	Tendance

---

---

## المترجم فى سطور

د. أيمن نايف العشعوش.

- من مواليد سوريا ١٩٦٥م.

### المؤهل العلمى:

- دكتوراه فى العلوم الاقتصادية - الاقتصاد القياسى للسلاسل الزمنية - من جامعة مونيخ الأولى فى فرنسا ١٩٩٨م.

### الوظيفة الحالية:

- أستاذ مساعد بإدارة البحوث والاستشارات بفرع المعهد بالمنطقة الشرقية.

### الأنشطة العلمية:

- Metal prices and the business cycle, Resources Policy – (1999) 229-238.
- La recherche des cycles économiques dans les prix des métaux par l'analyse dynamique a plusieurs facteurs ; Document de travail N. 97-04 (1997) LAMETA – Montpellier – France.
- دراسة إحصائية تحليلية لكمية الهطول المطرى فى سوريا خلال الفترة ١٩٩٠-٢٠٠٢م باستخدام السياقات العشوائية (مع آخرين)، مجلة جامعة تشرين للدراسات والبحوث العلمية - سلسلة العلوم الاقتصادية المجلد (٢٦) العدد (٢) ٢٠٠٤م.
- كتاب: أساليب كمية (١)، مع د. هنادى شمعون، برنامج التعليم المفتوح لإدارة الأعمال - كلية الاقتصاد - جامعة تشرين ٢٠٠٤م.

achoucha@ipa.edu.sa

البريد الإلكتروني:

ayman-achouch@hotmail.com

## مراجع الترجمة فى سطور

د. صالح بن ضحوي العنزي.

- من مواليد عام ١٩٥٥م.

### المؤهل العلمى:

- درجة الدكتوراه فى علوم اللغة الفرنسية من جامعة السوربون - باريس ٢ - فرنسا عام ١٩٨٨م.

- دكتوراه الحلقة الثالثة فى اللغويات الفرنسية جامعة غرنوبل - فرنسا عام ١٩٨٤م.

### الوظيفة الحالية:

- أستاذ مشارك - قسم اللغات الأوروبية والترجمة - كلية اللغات والترجمة - جامعة الملك سعود بالرياض.

### الأنشطة العلمية والعملية:

١- ترجمة بحث - من الفرنسية للعربية - لمجموعة من الأساتذة الفرنسيين عن تكاليف التعليم العالى فى فرنسا ١٩٩٨م.

٢- ترجمة كتاب (حقوق الإنسان وتطبيقاتها فى المملكة العربية السعودية) للفرنسية - تأليف الأستاذ الدكتور سليمان الحقيلى - جامعة الإمام محمد بن سعود، نشر عام ١٤٢١هـ الرياض، مكتبة الملك فهد.

٣- ترجمة كتاب (دروس من القرآن الكريم) للشيخ صالح الفوزان ونشر فى دار المسلم بفرنسا ٢٠٠٦م.

٤- إعداد (معجم للمصطلحات الدعوية باللغة الفرنسية) منشور فى إدارة النشر والمطابع بجامعة الملك سعود، ١٤٢٦هـ.

٥- القيام بالترجمة الفورية والتبعية.

٦- بحث بعنوان (تأثير المصطلحات متعددة المعانى فى اللغة الأم على تعلم مفردات اللغة الإنجليزية) نشر باللغة الفرنسية فى المجلة العالمية للغويات التطبيقية (Iral) ميونخ ١٩٩٨م. سلسلة اللغويات والترجمة عام ١٤٢١هـ.

٧- بحث بعنوان (إشكالية تعلم أجوبة الشرط فى الفرنسية) نشر باللغة الفرنسية فى مجلة أبحاث جامعة اليرموك - الأردن عام ١٩٩٨م.

- 
- 
- ٨- بحث بعنوان (تأثير الأفعال متعددة المعانى للغة الأجنبية فى عملية الترجمة) نشر باللغة الفرنسية فى مجلة جامعة الملك سعود - سلسلة اللغويات والترجمة عام ١٤٢٢هـ.
- ٩- بحث بعنوان (كيفية ترجمة مصطلحات البغض ذات البعد الثقافى الاجتماعى) نشر فى مجلة جامعة الملك سعود - سلسلة اللغويات والترجمة ١٤٢٤هـ.
- ١٠- بحث بعنوان (الظرفية فى الفرنسية من الكفاءة اللغوية إلى القدرة على الترجمة) نشر فى مجلة أبحاث جامعة اليرموك ٢٠٠٢م.
- ١١- بحث بعنوان (النمط الفعلى الشرطى فى الإنجليزية والفرنسية - تطبيق تدريس الإنجليزية والفرنسية للطلاب العرب) نشر بمجلة جامعة الملك سعود - سلسلة اللغويات والترجمة ١٤٢٦هـ.
- ١٢- المشاركة فى المؤتمر الدولى الثالث للغويات والآداب والترجمة المنعقد فى جامعة اليرموك - الأردن بورقة بحث بعنوان دراسة مقارنة لأجوبة الشرط فى الإنجليزية والفرنسية ١٩٩٦م.
- ١٣- إلقاء محاضرات خلال دورة موجهة لمدرسى ومدرسات اللغة الفرنسية فى الرياض عن وضع مهارات الكتابة لدى الطلبة السعوديين ١٤٢١هـ.
- ١٤- حضور مؤتمر وورشات العمل المصاحبة بعنوان (الوصف الإلكتروني للغة الفرنسية) مونتريال كندا ١٤٢٧هـ.
- ١٥- تنظيم ندوات فى كلية اللغات والترجمة تتعلق بمنهجية تدريس مقررات الترجمة ١٤٢٢-١٤٢٦هـ.
- ١٦- إعداد نشرات برامج باللغة الفرنسية للإذاعة السعودية - البرنامج الثانى - عن وضع المرأة فى المملكة، حقيقة وضع حقوق الإنسان فى الإسلام، الإسلام دين الوسطية، جهود المملكة لمكافحة الإرهاب، سياسة التعليم فى المملكة .... وذلك منذ عام ١٤٢٤هـ حتى الآن.
- ١٧- نشر عدة مقالات فى مجلة الإمامة عام ٢٠٠٠م عن الرواية العربية فى الغرب.



حقوق الطبع والنشر محفوظة لمعهد الإدارة العامة ولا يجوز  
اقتباس جزء من هذا الكتاب أو إعادة طبعه بأية صورة دون  
موافقة كتابية من المعهد إلا في حالات الاقتباس القصير  
بغرض النقد والتحليل، مع وجوب ذكر المصدر.



تم التصميم والإخراج الفنى والطباعة فى  
الإدارة العامة للطباعة والنشر بمعهد الإدارة العامة - ١٤٢٩هـ

## هذا الكتاب

يعتبر من الكتب الحديثة القليلة التي تعالج موضوع التنبؤ بالمبيعات، فهو يعرض عرضاً سهلاً للطرائق المختلفة للتنبؤ بالمبيعات وكيفية إنشاء نظام متكامل للتنبؤ والتحقق منه وتقييمه.

فبعد عرض مبسط للمفاهيم الإحصائية والاقتصادية القياسية الضرورية، يقترح المؤلفان عدة طرائق مختلفة للتنبؤ تبعاً لقطاع النشاط الذي تمارسه المنشأة. فنجد طريقة خاصة للتنبؤ من أجل السلع الصناعية وأخرى من أجل السلع ذات الاستهلاك الكبير والدائم. ولقد حرص المؤلفان على توضيح هذه الطرائق من خلال مجموعة من الأمثلة التطبيقية عن كل حالة. كما تمّ عرض الآلية التفصيلية لإنشاء نظام متكامل للتنبؤ بدءاً بعملية جمع البيانات ومروراً بمفهوم نظام المعلومات ومن ثمّ تقييم جودة التنبؤ. كما تمّ التعرض لآلية اختيار البرمجيات الحاسوبية الملائمة.

ولكى يستطيع القارئ استخدام طرائق التنبؤ المعروضة وإعادة حل التطبيقات الواردة في الكتاب، استعرض المؤلفان بيانات الأمثلة والتمارين المحلولة على موقع الشبكة العنكبوتية التالي: <http://www.dauphine.fr/cip/pages/bournonnais/>.

أراد المؤلفان أن يقدموا حلولاً لمسائل حقيقية تتعلق بمعطيات واقعية لبعض القطاعات الاقتصادية من خلال هذا الكتاب، إضافة إلى كونه أداة تعريفية للتنبؤ.

يُوجّه هذا الكتاب بشكل عام إلى جميع المهنيين العاملين في مجال التسويق والتمويل والتجارة وإلى طلاب العلوم الإدارية والاقتصادية وإلى المعاهد التجارية العليا.

ردمك : ١ - ١٦٧ - ١٤ - ٩٩٦٠ - ٩٧٨